鹏华新丝路指数分级证券投资基金

2015 年度报告摘要

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
送出日期:2016年3月30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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2016年3月25日复核了本报告中的财务指标、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,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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师对本基金出具了"标准无保留意见"的审计报告。

本报告期自2015年8月13日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华新丝路分级		
场内简称	新丝路		
基金主代码	502026		
交易代码	502026		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年8月13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		
报告期末基金份额总额	8,878,361.96份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	2015年8月24日		
下属分级基金的基金简称	新丝路	新丝路A	新丝路B
下属分级基金的场内简称	新丝路	新丝路A	新丝路B
下属分级基金的交易代码	502026	502027	502028
报告期末下属分级基金份额总额	8,072,123.96份	403,119.00份	403,119.00份

2.2 基金产品说明

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。		
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法,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。 本基金力争鹏华钢铁份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 1.股票投资策略 (1)股票投资组合的构建 本基金在建仓期内,将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入,在力求跟踪误差最小化的前提下,本基金可采取适当方法,以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依照标的指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时,本基金可以根据市场情况,结合经验判断,对基金资产进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。 (2)股票投资组合的调整 本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况,对其进行适时调整,以保证鹏华钢铁份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。本基金将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到持股比例限制,基金可能不能按照成份股权重持有成份股,基金将会采用合理方法寻求替代。 1)定期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。 2)不定期调整 根据指数编制规则,当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时,本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整; 根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数; 根据法律、法规规定,成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的,本基金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。 2.债券投资策略 本基金可以根据流动性管理需要,选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化,并利用债券定价技术,进行个券选择。 3.衍生品投资策略 本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生工具。 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,降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本,达到稳定投资组合资产净值的目的。 基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。 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。 4.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	新丝路指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%		
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与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。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。		
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与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。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。	鹏华新丝路A份额为稳健收益类份额,具有低风险且预期收益相对较低的特征。	鹏华新丝路B份额为积极收益类份额,具有高风险且预期收益相对较高的特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	张燕
	联系电话	0755-82825720	0755-83199084
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006788999	95555
传真		0755-82021126	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
基金年度报告备置地点	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 深圳市深南大道7088号招商银行大厦招商银行股份有限公司

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年8月13日(基金合同生效日)-2015年12月31日
本期已实现收益	1,595,366.43
本期利润	2,576,333.47
加权平均基金份额本期利润	0.0547
本期基金份额净值增长率	13.30%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.0842
期末基金资产净值	10,061,544.83
期末基金份额净值	1.133

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) 表中的"期末"均指报告期最后一日,即12月31日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

(4) 本基金基金合同于2015年8月13日生效,至2015年12月31日未满一年,故2015年的数据和指标为非完整会计年度数据。

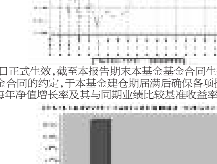
3.2 基金净值表现

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	12.96%	1.85%	25.50%	1.97%	-12.54%	-0.12%
自基金合同生效起至今	13.30%	1.50%	-7.93%	2.90%	21.23%	-1.40%

注:业绩比较基准=新丝路指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%

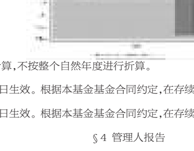
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同于2015年8月13日正式生效,截至本报告期末本基金合同生效未满一年。

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:合同生效当年按照实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金基金合同于2015年8月13日生效。根据本基金基金合同约定,在存续期内,本基金(包括新丝路份额、新丝路A份额、新丝路B份额)不进行收益分配。

注:本基金基金合同于2015年8月13日生效。根据本基金基金合同约定,在存续期内,本基金(包括新丝路份额、新丝路A份额、新丝路B份额)不进行收益分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于1998年12月22日,业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末,公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)、深圳市北融信投资发展有限公司组成,公司性质为中外合资企业。公司原注册资本8,000万元人民币,后于2001年9月完成增资扩股,增至15,000万元人民币。截止本报告期末,公司管理88只开放式基金和10只社保组合,经过17年投资管理基金,在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
焦文龙	本基金基金经理	2015年8月13日	-	6	焦文龙先生,国籍中国,经济学硕士,6年证券从业经验。2009年6月加盟鹏华基金管理有限公司,历任监察稽核部金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员,先后从事金融工程、量化研究等工作;2015年5月起担任鹏华一带一路分级基金基金经理,2015年5月起兼任鹏华高铁产业分级基金、鹏华新能源分级基金基金经理,2015年8月起兼任鹏华新丝路分级基金、鹏华钢铁分级基金基金经理,2015年11月起兼任鹏华创业板分级基金基金经理。焦文龙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,增聘崔惠军担任本基金基金经理。本基金为本期内新成立基金。
崔惠军	本基金基金经理	2015年8月14日	-	14	崔惠军先生,国籍中国,经济学硕士,14年证券从业经验。曾任职于世纪证券有限责任公司证券投资部,担任分析师;中企东方资产管理有限公司投资策略部,担任高级经理;东方证券股份有限公司证券投资部、金融衍生品部,先后担任高级投资经理、投资总监、总经理助理;2015年6月加盟鹏华基金管理有限公司,担任量化及衍生品投资部总经理助理,从事投研工作,2015年8月起担任鹏华新丝路分级基金基金经理。崔惠军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,增聘崔惠军担任本基金基金经理。本基金为本期内新成立基金。

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本基金基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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,本基金运作合法合规,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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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》,将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的投资(包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估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,建立对公平交易的执行、监督及审核流程,严禁在不同投资组合之间进行利益输送。在投资研究环节:1、公司使用唯一的研究报告发布平台"研究报告管理平台",确保各投资组合在获得投资信息、研究报告、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用产品投资管理规定》,执行股票及信用产品出入库及日常维护工作,确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据;3、在公司股票库基础上,各涉及投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库,基金经理在股票库基础上根据投资授权以及服务方式构建具体的投资组合;4、严格执行投资授权制度,明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分,合理确定基金经理的投资权限,超过投资权限的操作,应严格履行审批程序。在交易执行环节:1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成,集中交易室负责建立和执行交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会;2、针对交易所公开竞价交易,集中交易室应严格启用恒生交易系统中的公平交易程序,交易系统则自动启用公平交易功能,由系统按照"未委托数量"的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配;如果相关投资组合经理坚持以不同的价格进行交易,且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时,则交易系统自动按照"价格优先"原则进行委托;当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时,则交易系统自动采取"同一指令价格下的公平交易"模式,进行公平委托和交易量分配;3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行;银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易,各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量,公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;4、新股、新债申购及非公开定向增发流程》的规定执行,对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。在交易监控、分析与评估环节:1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理,杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为,防范日常交易风险,公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制;所监控的交易包括但不限于:交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等;2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容,发现的异常情况由投资监察员进行分析;3、监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》,内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析;《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

4.3.2 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。同时,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析,未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.3 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。

报告期内,本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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金秉承指数基金的投资策略,在应对申购赎回的基础上,跟踪指数收益,力争将基金跟踪误差控制在合理范围内。

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1.133元,累计净值1.133元。本报告期基金份额净值增长率为13.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年,宏观经济继续下行,延续了2010年以来的经济增速下降、流动性宽松的过程。宏观经济的萎靡加速了深化国企改革、一带一路、人民币加入SDR等各项政策的进程,总体而言,2015年的宏观经济仍存在一些结构性亮点。

展望2016年,宏观层面的压力加大了继续调整结构和深化改革的力度和预期。证券市场在经历过去一年的"大幅上涨-大幅下跌"的过程之后,市场波动率在逐步下降,市场结构性机会较多,长期而言,支持A股上行的积极因素正在聚集,机会大于风险。

本基金作为被动管理的指数基金,在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下,将继续秉承指数化投资管理策略,积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,进一步降低基金的跟踪误差,力争投资回报与业绩基准保持一致。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1)日常估值流程

基金的估值由基金会计负责,基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体,独立建账、独立核算,保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理;每日按时接收成交数据及权益数据,进行基金估值。基金会计估值数据经基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式,每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对;每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外,还设有基金会计复核岗位,负责基金会计核算的日常事后复核工作,确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格,在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验,熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

(2)特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定,本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组,成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论,发表相关意见和建议,与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、根据本基金基金合同约定,在存续期内,本基金(包括新丝路份额、新丝路A份额、新丝路B份额)不进行收益分配。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形。截至报告期末,本基金资产净值仍低于五千万元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师对本基金出具了"标准无保留意见"的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:鹏华新丝路指数分级证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日
资 产:		
银行存款		1,022,721.75
结算备付金		8,571.64
存出保证金		23,953.20
交易性金融资产		9,267,710.73
其中:股票投资		9,267,710.73
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		-
应收证券清算款		24,438.59
应收利息		5,660.24
应收股利		-
应收申购款		146,943.57
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		10,499,999.72
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		19,457.73
应付赎回款		121,138.73
应付管理人报酬		15,035.51
应付托管费		3,307.81
应付销售服务费		-
应付交易费用		67,428.16
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		212,086.95
负债合计		438,454.89
所有者权益:		
实收基金		8,878,361.96
未分配利润		1,183,182.87
所有者权益合计		10,061,544.83
负债和所有者权益总计		10,499,999.72

注:(1)报告截止日2015年12月31日,基金份额总额8,878,361.96份,其中新丝路份额总额8,072,123.96份,基金份额参考净值1.133元;新丝路A份额总额403,119.00份,基金份额参考净值1.019元;新丝路B份额总额403,119.00份,基金份额参考净值1.247元;。

(2)本基金基金合同于2015年8月13日生效,无上年度末数据。

7.2 利润表

会计主体:鹏华新丝路指数分级证券投资基金

本报告期:2015年8月13日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年8月13日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入		3,159,075.09
1.利息收入		161,134.12
其中:存款利息收入		77,160.05
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		83,974.07
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		1,495,694.28
其中:股票投资收益		1,495,535.88
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		158.40
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		980,967.04
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		521,279.65
减:二、费用		582,741.62
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	171,352.22
2. 托管费	7.4.8.2.2	37,697.52
3. 销售服务费		-
4. 交易费用		109,785.53
5. 利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用		263,906.35
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		2,576,333.47
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		2,576,333.47

注:(1)报告实际编制期间为2015年8月13日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

(2)本基金基金合同于2015年8月13日生效,无上年度可比较期间及可比较数据。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:鹏华新丝路指数分级证券投资基金

本报告期:2015年8月13日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年8月13日(基金合同生效日)至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	338,553,007.95	-	338,553,007.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,576,333.47	2,576,333.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-329,674,645.99	-1,393,150.60	-331,067,796.59
其中:1.基金申购款	79,995,998.53	5,955,745.30	85,951,743.83
2.基金赎回款	-409,670,644.52	-7,348,895.90	-417,019,540.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	8,878,361.96	1,183,182.87	10,061,544.83

注:(1)报告实际编制期间为2015年8月13日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

(2)本基金基金合同于2015年8月13日生效,无上年度可比较期间及可比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

______邓召明______ ______高鹏______ ______郝文高______

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鹏华新丝路指数分级证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]766号《关于准予鹏华新丝路指数分级证券投资基金注册的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币338,520,631.30元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第937号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》于2015年8月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为338,553,007.95份基金份额,其中认购资金利息折合32,376.65份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》并报中国证监会备案,本基金的基金份额包括鹏华新丝路指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称"鹏华新丝路份额")、鹏华新丝路指数分级证券投资基金之A份额(以下简称"鹏华新丝路A份额")、鹏华新丝路指数分级证券投资基金之B份额(以下简称"鹏华新丝路B份额")。根据对基金财产及收益分配的不同安排,本基金的基金份额具有不同的风险收益特征。鹏华新丝路份额为可以申购、赎回并且能上市交易的基金份额,具有与标的指数相似的风险收益特征。鹏华新丝路A份额与鹏华新丝路B份额为可以上市交易但不能申购、赎回的基金份额,其中鹏华新丝路A份额为稳健收益类份额,具有低风险且预期收益相对较低的风险收益特征,鹏华新丝路B份额为积极收益类份额,具有高风险且预期收益相对较高的风险收益特征。鹏华新丝路A份额与鹏华新丝路B份额的配比始终保持1:1的比率不变。本基金的基金份额初始公开发售结束后,场外认购的全部份额将确认为鹏华新丝路份额;场内认购的份额将按照2:4:4的比例分别确认为场内鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额。本基金基金合同生效后,场内鹏华新丝路份额与鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换,包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。基金份额的分拆,指基金份额持有人将其持有的场内鹏华新丝路份额按照2份场内鹏华新丝路份额对应1份鹏华新丝路A份额与1份鹏华新丝路B份额的比例进行转换的行为;基金份额的合并,指基金份额持有人将其持有的鹏华新丝路A份额与鹏华新丝路B份额按照1份鹏华新丝路A份额与1份鹏华新丝路B份额对应2份场内鹏华新丝路份额的比例进行转换的行为。

基金份额的净值按如下原则计算:鹏华新丝路份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数,其中基金份额总数为鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额的份数之和。鹏华新丝路A份额的基金份额净值为鹏华新丝路A份额的本金及约定应得收益之和。每2份鹏华新丝路份额所对应的基金资产净值等于1份鹏华新丝路A份额与1份鹏华新丝路B份额所对应的基金资产净值之和。

本基金定期进行份额折算。在鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路份额存续期内的每个会计年度9月第一个工作日,本基金将进行基金的定期份额折算。在基金份额折算前与折算后,鹏华新丝路A份额与鹏华新丝路B份额的份额配比保持1:1的比例。对于鹏华新丝路A份额的约定应得收益,即鹏华新丝路A份额每个会计年度8月最后一个自然日基金份额参考净值超出1.000元部分,将折算为场内鹏华新丝路份额分配给鹏华新丝路A份额持有人。鹏华新丝路份额持有人持有的每2份鹏华新丝路份额将按1份鹏华新丝路A份额获得新增鹏华新丝路份额的分配。持有场外鹏华新丝路份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外鹏华新丝路份额的分配;持有场内鹏华新丝路份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内鹏华新丝路份额的分配。经过上述份额折算,鹏华新丝路A份额的基金份额参考净值调整为1.000元,鹏华新丝路份额的基金份额净值将相应调整。

除定期份额折算外,本基金还将在鹏华新丝路份额的基金份额净值达到1.500元时或鹏华新丝路B份额的基金份额参考净值跌至0.250元时进行不定期份额折算。当达到不定期折算条件时,本基金将分别对鹏华新丝路份额、鹏华新丝路A份额、鹏华新丝路B份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保鹏华新丝路A份额与鹏华新丝路B份额的比例为1:1,份额折算后鹏华新丝路份额的基金份额净值、鹏华新丝路A份额与鹏华新丝路B份额的基金份额参考净值均调整为1.000元。

经上海证券交易所(以下简称"上交所")自律监管决定书[2015]341号文审核同意,本基金鹏华新丝路份额20,537,936.00份基金份额、鹏华新丝路A份额41,075,869.00份基金份额和鹏华新丝路B份额41,075,869.00份基金份额于2015年8月24日在上交所挂牌交易。未上市交易的份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下,可以通过跨系统转托管转至中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记结算系统持有人上海证券账户下后,在上海证券交易所上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股及其备选成份股(含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票)、债券、股指期货、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于股票部分的比例不低于基金资产的80%,其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:新丝路指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年8月13日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年8月13日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2015年8月13日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币,除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1)金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

(2)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量,应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

(3)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动作为公允价值变动损益计入当期损益;在资产持有期间所取得的利息或现金股利以及处置时产生的处置损益计入当期损益。

(4)金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(4.1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(4.2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(4.3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

(5)金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

(6)当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

基金收益分配应遵循下列原则:

1.在存续期内,本基金(包括新丝路份额、新丝路A份额、新丝路B份额)不进行收益分配。

2.法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1)对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4)本基金根据中国证券投资基金业协会《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称"估值处理标准"),对于交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称"估值处理标准"),对于交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,暂免征收个人所得税。。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司("鹏华基金公司")	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司("招商银行")	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司("国信证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)	基金管理人的股东
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
鹏华资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注:1.本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

2.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金基金合同于2015年8月13日生效,截至本报告期末不满一年。无上年度可比期间和数据。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

注:无。

7.4.8.1.2 债券交易

注:无。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注:无。

7.4.8.1.4 权证交易

注:无。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年8月13日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	171,352.22
其中:支付销售机构的客户维护费	18,422.93

注:(1)支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为1.00%,逐日计提,按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.00%÷当年天数。

(2)根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》,基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费,用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,客户维护费从基金管理费中列支。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年8月13日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	37,697.52

注:支付基金托管人招商银行股份有限公司的托管费年费率为0.22%,逐日计提,按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.22%÷当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金本报告期基金管理人未投资、持有本基金。本基金基金合同生效日起至本报告期末未满一年,故无上年度可比期间数据。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年8月13日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	1,022,721.75	57,261.10

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期未参与关联方承销的证券。

7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600771	广誉远	2015年11月17日	重大事项	32.97	2016年3月9日	28.78	2,600	73,789.65	85,722.00	-
600090	啤酒花	2015年12月24日	重大事项	19.65	2016年1月4日	19.00	3,700	47,113.10	72,705.00	-
002207	准油股份	2015年12月16日	重大事项	21.42	-	-	2,500	42,546.71	53,550.00	-
600354	敦煌种业	2015年12月15日	重大事项	9.88	2016年1月19日	8.89	5,200	39,852.60	51,376.00	-
600714	金瑞矿业	2015年12月2日	重大事项	11.84	2016年3月4日	13.02	1,400	13,891.87	16,576.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	9,267,710.73	88.26
	其中:股票	9,267,710.73	88.26
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,031,293.39	9.82
7	其他各项资产	200,995.60	1.91
8	合计	10,499,999.72	100.00

1.1 期末按行业分类的股票投资组合

1.1.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	284,558.20	2.83
B	采矿业	1,065,428.00	10.59
C	制造业	5,688,833.00	56.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	202,951.00	2.02
E	建筑业	216,464.00	2.15
F	批发和零售业	469,852.00	4.67
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	43,806.00	0.44
I	信息传输、软件和信息技术服务业	83,793.00	0.83
J	金融业	959,551.53	9.54
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	223,696.00	2.22
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	28,788.00	0.29
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	9,267,710.73	92.11

1.1.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注:无。

1.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的指数投资前十名股票投资明细和积极投资前五名股票投资明细

1.2.1 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002202	金风科技	22,000	501,380.00	4.98
2	600893	中航动力	10,600	477,318.00	4.74
3	002673	西部证券	13,783	453,598.53	4.51
4	600089	特变电工	38,200	449,614.00	4.47
5	000166	申万宏源	37,500	401,625.00	3.99
6	000768	中航飞机	14,700	364,119.00	3.62
7	601012	隆基股份	20,900	285,285.00	2.84
8	600256	广汇能源	41,900	279,473.00	2.78
9	000415	渤海租赁	24,800	223,696.00	2.22
10	000792	盐湖股份	8,500	218,280.00	2.17

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站http://www.phfund.com的年度报告正文。

1.2.2 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

注:无。

1.3 报告期内股票投资组合的重大变动

1.3.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600089	特变电工	2,388,327.00	23.74
2	000768	中航飞机	2,010,294.50	19.98
3	000166	申万宏源	1,938,765.00	19.27
4	002202	金风科技	1,796,188.42	17.85
5	600893	中航动力	1,795,072.00	17.84
6	600256	广汇能源	1,563,432.00	15.54
7	002673	西部证券	1,390,274.80	13.82
8	601012	隆基股份	1,183,946.00	11.77
9	000415	渤海租赁	1,036,588.00	10.30
10	600307	酒钢宏兴	1,000,250.00	9.94
11	601168	西部矿业	949,533.00	9.44
12	600108	亚盛集团	930,319.00	9.25
13	601179	中国西电	926,470.32	9.21
14	000792	盐湖股份	841,080.92	8.36
15	600516	方大炭素	743,310.40	7.39
16	601225	陕西煤业	713,337.00	7.09
17	300159	新研股份	692,096.00	6.88
18	000516	国际医学	690,681.00	6.86
19	600343	航天动力	666,783.00	6.63
20	000697	炼石有色	600,795.00	5.97
21	002185	华天科技	576,029.00	5.73
22	600687	刚泰控股	543,161.28	5.40
23	601958	金钼股份	526,245.00	5.23
24	600545	新疆城建	488,137.00	4.85
25	600831	广电网络	408,186.00	4.06
26	600771	广誉远	400,244.00	3.98
27	600251	冠农股份	395,845.00	3.93
28	600509	天富能源	373,399.00	3.71
29	601369	陕鼓动力	371,568.00	3.69
30	000877	天山股份	368,422.00	3.66
31	600337	美克家居	358,776.00	3.57
32	000563	陕国投A	351,642.48	3.49
33	002100	天康生物	346,696.00	3.45
34	600720	祁连山	342,493.00	3.40
35	600869	智慧能源	341,268.00	3.39
36	300164	通源石油	340,485.00	3.38
37	600425	青松建化	324,856.00	3.23
38	002307	北新路桥	312,416.00	3.11
39	600737	中粮屯河	301,960.00	3.00
40	000837	秦川机床	297,577.00	2.96
41	600311	ST荣华	264,710.00	2.63
42	600778	友好集团	263,739.00	2.62
43	002646	青青稞酒	258,356.01	2.57
44	600090	啤酒花	254,635.00	2.53
45	600456	宝钛股份	252,490.00	2.51
46	300140	启源装备	248,616.00	2.47
47	600888	新疆众和	244,116.00	2.43
48	002267	陕天然气	234,013.00	2.33
49	002207	准油股份	231,404.00	2.30
50	603169	兰石重装	224,942.00	2.24
51	000159	国际实业	223,460.00	2.22
52	000962	东方钽业	221,070.00	2.20
53	002457	青龙管业	218,887.00	2.18
54	600354	敦煌种业	213,872.00	2.13
55	600581	八一钢铁	209,720.00	2.08
56	000564	西安民生	203,204.00	2.02

注:买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

1.3.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600089	特变电工	2,005,352.21	19.93
2	000768	中航飞机	1,687,863.00	16.78
3	000166	申万宏源	1,631,359.51	16.21
4	002202	金风科技	1,557,618.65	15.48
5	600256	广汇能源	1,301,793.00	12.94
6	002673	西部证券	1,249,895.00	12.42
7	601012	隆基股份	1,148,777.00	11.42
8	600893	中航动力	1,144,216.28	11.37
9	000415	渤海租赁	874,986.00	8.70
10	600307	酒钢宏兴	831,081.00	8.26
11	601168	西部矿业	797,882.00	7.93
12	601179	中国西电	790,918.99	7.86
13	600108	亚盛集团	767,356.00	7.63
14	000792	盐湖股份	734,251.62	7.30
15	600516	方大炭素	693,044.00	6.89
16	300159	新研股份	624,790.00	6.21
17	601225	陕西煤业	594,739.00	5.91
18	000516	国际医学	591,638.00	5.88
19	600343	航天动力	571,046.00	5.68
20	000697	炼石有色	524,201.29	5.21
21	600687	刚泰控股	511,881.00	5.09
22	002185	华天科技	487,778.00	4.85
23	601958	金钼股份	433,397.00	4.31
24	600545	新疆城建	400,023.00	3.98
25	600831	广电网络	346,567.00	3.44
26	600251	冠农股份	332,463.00	3.30
27	600771	广誉远	319,853.00	3.18
28	601369	陕鼓动力	317,087.00	3.15
29	000877	天山股份	313,496.00	3.12
30	600509	天富能源	313,100.00	3.11
31	000563	陕国投A	302,444.00	3.01
32	600720	祁连山	299,707.00	2.98
33	600337	美克家居	297,866.11	2.96
34	002100	天康生物	297,502.00	2.96
35	600311	ST荣华	289,907.00	2.88
36	600869	智慧能源	287,383.00	2.86
37	600425	青松建化	269,713.00	2.68
38	600737	中粮屯河	269,038.00	2.67
39	002307	北新路桥	255,927.00	2.54
40	000837	秦川机床	250,565.00	2.49
41	600090	啤酒花	230,121.00	2.29
42	600456	宝钛股份	217,511.00	2.16
43	002646	青青稞酒	217,172.00	2.16
44	603169	兰石重装	214,508.00	2.13
45	300164	通源石油	212,495.00	2.11
46	600888	新疆众和	206,817.00	2.06
47	300140	启源装备	206,353.00	2.05
48	600339	天利高新	204,951.00	2.04
49	000564	西安民生	202,378.00	2.01

注:卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

1.3.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	41,122,565.77
卖出股票收入(成交)总额	34,331,357.96

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

1.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

注:无。

1.5 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。

1.6 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。

1.7 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。

1.8 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。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期内未发生股指期货投资。

1.9.2 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,降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本,达到稳定投资组合资产净值的目的。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.10.1 本期国债期货投资政策

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

1.10.2 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。

1.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1

本基金投资的前十名证券之一的申万宏源证券于2015年11月6日收到中国证监会行政监管措施决定书《关于对申万宏源证券有限公司采取暂停新开证券账户1个月措施的决定》([2015]78号),称申万宏源证券外部接入具有分账户功能的第三方交易终端软件,未对外部系统接入实施有效管理,对相关客户身份情况缺乏了解。而且,在中国证监会下发《关于加强证券公司信息系统外部接入管理的通知》(证监办发[2015]35号)后,申万宏源证券在自查过程中存在向中国证监会漏报信息系统外部接入账户的情形。中国证监会责令申万宏源证券暂停新开证券账户1个月,暂停期间公司不得新增经纪业务客户。

本基金投资的前十名证券之一的盐湖股份于2015年6月10日公告,深圳证券交易所2015年1月监管函(公司部监管函[2015]第4号)称盐湖股份与关联方青海木里煤业开发集团有限公司2013年及2014年分别存在565万元及776万元的委托管理的关联交易;与关联方青海省能源发展公司2011-2014年分别存在4,814万元、1.41亿元、1.47亿元及3亿元的煤炭采购关联交易。盐湖股份未及时披露上述关联交易的行为违反了《上市规则》第2.1条规定。深圳证券交易所希望盐湖股份及全体董事吸取教训,严格遵守《证券法》、《公司法》等法规及《上市规则》的规定,及时、真实、准确、完整地履行信息披露义务,杜绝此类事件发生。

对上述股票的投资决策程序的说明:本基金为指数基金,为更好地跟踪标的指数,控制跟踪误差对上述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中的其它证券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。

1.11.2

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。

1.11.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	23,953.20
2	应收证券清算款	24,438.59
3	应收股利	-
4	应收利息	5,660.24
5	应收申购款	146,943.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	200,995.60

1.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:无。

1.11.5 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

1.11.6 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

1.11.7 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
新丝路	409	19,736.24	0.00	0.00%	8,072,123.96	100.00%
新丝路A	61	6,608.51	1,000.00	0.25%	402,119.00	99.75%
新丝路B	101	3,991.28	1,000.00	0.25%	402,119.00	99.75%
合计	571	15,548.80	2,000.00	0.02%	8,876,361.96	99.98%

9.2 期末上市基金前十名持有人

新丝路A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	李怡名	76,000.00	18.85%
2	章卫红	50,000.00	12.40%
3	徐丽娟	38,000.00	9.43%
4	向前	29,300.00	7.27%
5	章炎华	26,100.00	6.47%
6	向顺波	24,400.00	6.05%
7	邱贤奕	21,600.00	5.36%
8	王丹艳	19,802.00	4.91%
9	王敏	18,764.00	4.65%
10	李亮	15,000.00	3.72%

新丝路B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	李怡名	75,800.00	18.80%
2	林伟	58,954.00	14.62%
3	邱贤奕	29,906.00	7.42%
4	许文君	22,800.00	5.66%
5	葛伟华	21,295.00	5.28%
6	马学军	20,000.00	4.96%
7	王丹艳	19,802.00	4.91%
8	裴凤	11,900.00	2.95%
9	周孝武	11,657.00	2.89%
10	施鸿	10,000.00	2.48%
11	章伟莲	10,000.00	2.48%
12	袁崇军	10,000.00	2.48%
13	李宝发	10,000.00	2.48%

注:持有人为场内持有人。

1.1 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	新丝路	1,980.46	0.0245%
	新丝路A	-	-
	新丝路B	-	-
	合计	1,980.46	0.0223%

注:截至本报告期末,本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

1.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理本报告期末未持有本基金份额。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	新丝路	新丝路A	新丝路B
基金合同生效日(2015年8月13日)基金份额总额	256,401,269.95	41,075,869.00	41,075,869.00
本报告期期初基金份额总额	-	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	79,995,998.53	-	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	409,670,644.52	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	81,345,500.00	-40,672,750.00	-40,672,750.00
本报告期期末基金份额总额	8,072,123.96	403,119.00	403,119.00

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算中调整的份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人的重大人事变动:

报告期内,经公司董事会审议通过,并经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]217号文核准,公司聘任高永杰先生担任公司督察长,任职日期自2015年2月6日起。

报告期内,经公司董事会审议通过,自2015年9月19日起,同意聘任苏波先生担任公司副总经理。

报告期内,经公司原副总经理胡湘先生因个人职业发展原因提出辞职,经公司董事会审议,同意胡湘先生提出的辞职申请,并同意其在办理完工作交接手续后正式离任。胡湘先生于2015年10月17日正式离任。

报告期内,经公司董事会审议通过,自2015年10月17日起,同意聘任邢彪先生担任公司副总经理。

上述事项已按有关规定向中国证券监督管理委员会及深圳证监局报告,并按有关规定向中国证券投资基金业协会备案。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的,与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用45,000元。该审计机构为本基金提供审计服务的期间为本基金基金合同生效日(2015年8月13日)起到本报告期末,不满一年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人及其托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券	1	40,778,652.10	54.04%	37,156.25	54.04%	本报告期新增
中泰证券	1	33,521,562.63	44.43%	30,548.52	44.43%	本报告期新增
招商证券	1	1,153,709.00	1.53%	1,051.33	1.53%	本报告期新增
西南证券	2	-	-	-	-	本报告期新增
国金证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
川财证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
安信证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
东方证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
广发证券	1	-	-	-	-	本报告期新增

注:交易单元选择的标准和程序

1、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构,使用其交易单元作为基金的专用交易单元,选择的标准是:

(1)实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币;

(2)财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;

(3)经营行为规范,最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚;

(4)内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;

(5)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务;

(6)研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2、选择交易单元的程序:

我公司根据上述标准,选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比,评比内容包括:提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况,并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后,向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东北证券	-	-	17,000,000.00	0.81%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	2,090,000,000.00	99.19%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

鹏华基金管理有限公司

2016年3月30日