鹏华动力增长混合型证券投资基金（LOF）

【2014】第三季度报告

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月21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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华动力增长混合(LOF)
场内简称	鹏华动力
基金主代码	160610
交易代码	160610
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2007年1月9日
报告期末基金份额总额	3,839,727,993.21份
投资目标	精选具有高成长性和持续盈利增长潜力的上市公司中价值相对低估的股票,进行积极主动的投资管理,在有效控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	(1)股票投资:本基金股票投资采取"自上而下"和"自下而上"相结合的主动投资管理策略,策略分为战略性资产配置、动态资产配置和个股选择等三个层次,重点投资具备高成长性和持续盈利增长潜力的上市公司中价值相对低估的股票。 (2)债券投资:本基金债券投资的主要目的是规避股票投资部分的系统性风险,在投资过程中综合运用久期、收益率曲线、流动性、相对价值挖掘、套利等策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金属于混合型(偏股型)基金,其预期风险和收益高于货币型基金、债券基金、混合型基金中的偏债型基金,低于股票型基金,为证券投资基金中的中等风险品种。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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(2014年7月1日－2014年9月30日)
1.本期已实现收益	17,577,747.08
2.本期利润	451,130,642.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.1113
4.期末基金资产净值	4,482,747,244.77
5.期末基金份额净值	1.167

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。

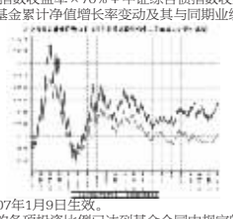
3.2 基金净值表现

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	10.62%	0.75%	9.62%	0.63%	1.00%	0.12%

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%。

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2007年1月9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。

§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		
黄鑫	本基金基金经理	2010年7月26日	-	12	黄鑫先生,国籍中国,管理学硕士,12年证券从业经验。曾在民生证券公司证券投资部、长城证券公司研究所从事研究工作。2004年10月加盟鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作,曾任公司机构理财部理财经理助理、理财经理;2007年8月至2011年1月担任鹏华中国50开放式证券投资基金基金经理,2008年10月至2010年7月担任鹏华盛世创新股票型证券投资基金(LOF)基金经理,2010年7月起至今担任鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)基金经理,2014年1月起兼任鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现同时担任研究部总经理、投资决策委员会成员。黄鑫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

本季度A股市场迎来了一场小牛市。在2季度经济数据回暖的背景下,沪港通的临近触发了大盘股蓝筹股的价值回归行情,只是由于宏观经济又重回疲弱,蓝筹股的上涨陷入停滞。但小盘股、重组股和题材股很快成为市场走高的接力棒,产业资本一二级市场联动模式在本季度演绎的淋漓尽致。

中国经济和资本市场当前处于一个大变革、大整合的时代。过往的诸多盈利模式正在被削弱,生存者或者是颠覆者,或者是整合者。据此,判断公司投资价值的标准也需要适时调整,我们在3季度重新审视组合的持仓品种,对组合进行了一定的调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为10.62%,同期上证综指上涨15.40%,深证成指上涨10.04%,沪深300指数上涨13.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市,我们仍然持谨慎乐观态度。在3季度业绩披露窗口期,由于整体经济形势不佳,上市公司季报可能有一定压力。但我们认为今年以来市场的运行逻辑没有被打破,转型、升级、整合仍然会是主线。因此4季度市场的可能调整将是一个调整组合结构的好时机,我们将重点在新能源汽车、半导体、国企改革等投资方向上选择合适的品种进行布局。

§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	3,804,007,988.96	84.47
	其中:股票	3,804,007,988.96	84.47
2	固定收益投资	184,368,863.66	4.09
	其中:债券	184,368,863.66	4.09
	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	513,510,626.17	11.40
7	其他资产	1,526,725.98	0.03
8	合计	4,503,414,204.77	100.00

5.2 报告期末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	105,954,560.72	2.36
B	采矿业	111,427,706.28	2.49
C	制造业	2,731,150,894.09	60.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	97,909,259.64	2.18
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	232,072,225.85	5.18
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,122,000.00	0.11
J	金融业	82,677,354.24	1.84
K	房地产业	111,110,000.00	2.48
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	134,636,129.10	3.00
N	水利、环境和公共设施管理业	72,083,614.04	1.61
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,808,595.00	0.06
Q	卫生和社会工作	117,055,650.00	2.61
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,804,007,988.96	84.86

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	600887	伊利股份	10,500,000	271,950,000.00	6.07
2	002250	联化科技	17,000,000	268,600,000.00	5.99
3	000848	承德露露	11,312,343	248,645,299.14	5.55
4	000513	丽珠集团	3,900,000	205,842,000.00	4.59
5	002701	奥瑞金	8,000,000	182,320,000.00	4.07
6	600201	金宇集团	4,395,828	154,161,687.96	3.44
7	600535	天士力	3,602,233	149,780,848.14	3.34
8	002022	科华生物	5,000,000	134,700,000.00	3.00
9	300012	华测检测	6,738,545	134,636,129.10	3.00
10	000963	华东医药	2,100,000	125,790,000.00	2.81

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	184,368,863.66	4.11
8	其他	-	-
9	合计	184,368,863.66	4.11

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

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	113001	中行转债	1,006,730	104,256,958.80	2.33
3	113002	工行转债	288,090	31,364,358.30	0.70
3	110027	东方转债	212,160	25,499,510.40	0.57
4	113003	重工转债	114,820	15,711,968.80	0.35
5	110023	民生转债	62,060	5,806,333.60	0.13

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

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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

5.9.2 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。

5.10 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

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	559,416.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	614,593.92
5	应收申购款	337,592.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,123.36
8	其他	-
9	合计	1,526,725.98

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	104,256,958.80	2.33
2	113002	工行转债	31,364,358.30	0.70
3	113003	重工转债	15,711,968.80	0.35
4	110023	民生转债	5,806,333.60	0.13
5	128002	东华转债	485,570.40	0.01

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	000513	丽珠集团	205,842,000.00	4.59	筹划重大事项
2	600201	金宇集团	154,161,687.96	3.44	筹划重大事项

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	4,288,286,879.21
报告期期间基金总申购份额	13,508,134.20
减:报告期期间基金总赎回份额	462,067,020.20
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	3,839,727,993.21

§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

截止本报告期末,本基金管理人未持有本基金份额。

7.2 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)《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》;

(二)《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)托管协议》;

(三)《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)2014年第3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28号凯晨世贸中心东座F9中国农业银行股份有限公司

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10月24日

鹏华中证800非银行金融指数分级证券投资基金

【2014】第三季度报告

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10月24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10月21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2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华非银行分级		
场内简称	鹏华非银		
基金主代码	160625		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年5月5日		
报告期末基金份额总额	146,758,111.32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,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。 本基金力争鹏华非银行分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。		
业绩比较基准	中证800非银行金融指数收益率×95%+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。		
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		
下属三级基金简称	鹏华非银	非银行A	非银行B
下属三级基金交易代码	160625	150177	150178
下属三级基金报告期末基金份额总额	65,433,801.32份	40,662,155.00份	40,662,155.00份
下属三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。	鹏华非银行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。	鹏华非银行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。

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,上市交易开封闭运作的基金份额可分别简称为"非银行A"、"非银行B"。

§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(2014年7月1日－2014年9月30日)
1.本期已实现收益	4,650,589.03
2.本期利润	20,066,600.48
3.加权平均基金份额本期利润	0.1391
4.期末基金资产净值	169,210,612.17
5.期末基金份额净值	1.153

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。

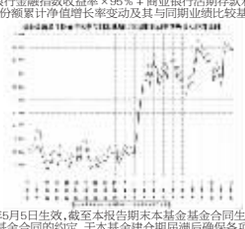
3.2 基金净值表现

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	16.58%	1.29%	16.84%	1.29%	-0.26%	0.00%

注:业绩比较基准=中证800非银行金融指数收益率×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、本基金基金合同于2014年5月5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		
余斌	本基金基金经理	2014年5月5日	-	7	余斌先生,经济学硕士,7年证券从业经验。曾任职于招商证券股份有限公司,担任风险控制部市场风险分析师;2009年10月加盟鹏华基金管理有限公司,历任机构理财部大客户经理、量化投资部量化研究员、先锋从事特定客户资产管理业务产品设计、量化研究等工作;2014年5月起至今担任鹏华中证信息技术指数分级证券投资基金基金经理,2014年5月起至今担任鹏华中证800非银行金融指数分级证券投资基金基金经理。余斌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

第三季度债券市场先跌后涨。前期受二季度经济数据回暖及资金略有收紧的影响,债券收益率出现快速上行;8月后,由于国内房地产市场依然保持低迷,内需增长乏力,国内经济增速继续回落,同时央行持续实施定向宽松货币政策,下调正回购招标利率,导致市场资金面保持宽松局面,机构买盘较为踊跃,尤其是银行理财规模大幅增长,债券配置力度加大,推动了债券收益率曲线平坦化下行。第三季度所有全价及财富指数均出现不同程度的上涨,企业债财富指数上涨幅度最大,涨幅达2.22%。

在第三季度,基于对经济整体仍较为低迷,债券市场整体风险不大的判断,组合维持了中性久期,主要配置了3至5年期的中期品种,其中信用品种以中高评级为主。此外,我们还选择的参与了部分可转债的申购。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本季度基金份额净值增长率为3.27%,业绩基准增长率为1.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望第四季度,虽然近期政府密集推出多项改革措施,有助于经济结构转型,释放经济增长动力;但短期而言,当前经济仍面临产能过剩和需求疲软问题,若政府坚持定向调控思路,稳增长措施实施较为缓慢,则经济增速可能进一步滑落。因此,从基本面上来看,目前债券市场整体风险不大。

但是我们需要密切关注未来稳增长政策的推进力度,以及社会融资总量的上升速度,如果出现明显加速,可能会通过市场预期变化或资金面变化为债券市场带来调整压力。此外,今年以来债券市场大幅上涨,主要期限品种债券收益率已创年内新低,机构进一步配置债券动力可能略有减弱,短期内债券收益率继续大幅回落的可能性也进一步下降。

信用产品方面,由于理财规模增长较为迅速,其债券配置力度仍较大,短期内信用利差难以大幅扩大。但对于低评级信用债而言,在经济增速继续滑落、企业盈利尚未改善情况下,信用风险事件仍可能陆续发生,使得信用利差依然易上难下。后期投资中我们将继续规避中低评级信用债,以有效控制风险。

综合而言,我们预计四季度债券收益率呈窄幅整理格局,投资收益可能主要来自于票息收入。组合将保持中性久期,品种选择方面,预计仍会以中高评级信用债为主。

§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	160,456,037.62	93.91
	其中:股票	160,456,037.62	93.91
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	9,045,203.65	5.29
7	其他资产	1,365,344.05	0.80
8	合计	170,866,585.32	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	160,456,037.62	94.83
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	160,456,037.62	94.83

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注: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	600030	中信证券	1,807,000	24,069,240.00	14.22
2	601318	中国平安	508,888	21,037,429.92	12.43
3	600837	海通证券	1,891,800	19,523,376.00	11.54
4	601601	中国太保	734,840	14,263,244.40	8.43
5	000776	广发证券	691,900	7,576,305.00	4.48
6	600999	招商证券	543,100	6,316,253.00	3.73
7	601688	华泰证券	654,500	5,969,040.00	3.53
8	601901	方正证券	962,300	5,908,522.00	3.49
9	601628	中国人寿	350,700	5,453,385.00	3.22
10	000783	长江证券	776,200	5,301,446.00	3.13

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

注: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

注: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序的前五名债券投资明细

注: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序的前十名资产支持证券投资明细

注: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序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

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:本基金本报告期末未持有权证。

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:本基金本报告期末未发生股指期货投资。

5.9.2 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国债期货投资。

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

1、中国平安

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。

2、华泰证券

本基金投资的前十名证券之一的华泰证券股份有限公司(以下简称"华泰证券")于2014年9月6日发布公告称,华泰证券收到中国证监会《关于对华泰证券股份有限公司采取责令改正措施的决定([2014]62号)》(以下简称《决定》)。《决定》的主要内容为:"你公司管理的华泰紫金增强债券集合资产管理计划、华泰紫金周期轮动集合资产管理计划等多个资产管理计划在2013年1月至2014年3月期间,存在同日或隔日通过交易对手实现不同计划之间间接进行债券买卖交易的情形。上述行为违反了《证券公司客户资产管理业务管理办法》第三条、第三十三条的规定。同时,中国人民银行南京分行于2014年6月就此事项对你公司进行行政处罚,但你公司并未及时向监管部门报告。按照《证券公司客户资产管理业务管理办法》第五十七条的规定,责令你公司予以改正。"

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,任务华泰证券是国内较大的证券公司,经营稳健,发展势头良好。从处罚公告中知悉,华泰证券违反的管理规定对华泰证券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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	134,880.25
2	应收证券清算款	1,039,166.46
3	应收股利	-
4	应收利息	1,888.42
5	应收申购款	162,686.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	26,722.35
8	其他	-
9	合计	1,365,344.05

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 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

注: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。

5.11.6 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

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.11.7 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	鹏华非银	非银行A	非银行B
报告期期初基金份额总额	72,807,908.02	46,027,997.00	46,027,997.00
报告期期间基金总申购份额	107,421,242.46	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	125,527,033.16	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	10,731,684.00	-5,365,842.00	-5,365,842.00
报告期期末基金份额总额	65,433,801.32	40,662,155.00	40,662,155.00

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§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:截止本报告期末,本基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注: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)《鹏华中证800非银行金融指数分级证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华中证800非银行金融指数分级证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华中证800非银行金融指数分级证券投资基金2014年第3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