

鹏华中证800证券保险指数分级证券投资基金

[2015] 第一季度报告

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
报告期截止日:2015年3月31日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本基金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。

基金托管人对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，但对于报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告部分，不承担复核责任。

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。投资人投资需谨慎。

基金管理人未委托任何机构和个人代理本基金的招募说明书。

本报告期末2015年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:鹏华中证800证券保险指数分级证券投资基金

基金代码:160616

基金运作方式:契约型开放式

上市交易场所:深圳证券交易所

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

报告期截止日:2015年3月31日

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)

1.本期已实现收益 242,194.0762

2.本期利润 610,856.9857

3.加权平均基金份额本期利润 0.01091

4.期末基金资产净值 10,884,006.9336

5.期末基金份额净值 1.0107

注:1.本期利润为以人民币计价的本期已实现收益,税后收益(不含公允价值变动收益)扣除红利和除费用后的余额,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.截至本期期末,本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例。

3.管理人报告

根据中国证监会证监基金字[2014]1103号文,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”。该公司的子公司平安信托有限责任公司简称“平安信托”于2015年1月6日收到《中国保监会行政处罚决定书》,称平安信托在经营过程中存在挪用保险资金、违规向关联方提供融资、违规向关联方提供担保等违法行为,并处以罚款30万元的行政处罚。同时,平安信托还因存在挪用保险资金、违规向关联方提供融资、违规向关联方提供担保等违法行为,被中国保监会依法责令改正,并处以罚款30万元的行政处罚。本公司将密切关注该事项的进展,并根据相关法律法规的规定履行信息披露义务。

4.报告期内本基金投资的前十名证券的名称及其在基金资产中的占比

5.报告期内本基金投资的前十名行业分类

6.期末持有的处于转股期的可转换债券情况

7.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的前十名股票

8.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的前五名债券

9.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的前十名资产支持证券

10.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的前五名贵金属

11.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的其他金融工具

12.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的组合类金融产品

13.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的股指期货

14.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的国债期货

15.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的融资融券

16.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的权证

17.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的其他投资

18.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的买入返售金融资产

19.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的卖出回购金融资产

20.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的应收款项

21.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的其他应收款

22.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的存货

23.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的递延所得税资产

24.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的其他资产

25.期末持有的待摊费用

26.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的其他负债

27.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的负债

28.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的实收基金

29.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的资本公积

30.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的盈余公积

31.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的未分配利润

32.期末持有的待摊费用

33.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的其他负债

34.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的负债

35.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的实收基金

36.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的资本公积

37.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的盈余公积

38.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的未分配利润

39.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的负债

40.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的实收基金

41.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的资本公积

42.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的盈余公积

43.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的未分配利润

44.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的负债

45.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的实收基金

46.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的资本公积

47.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的盈余公积

48.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的未分配利润

49.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的负债

50.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的实收基金

51.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的资本公积

52.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的盈余公积

53.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的未分配利润

54.管理人报告

根据中国证监会证监基金字[2014]1103号文,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”。该公司的子公司平安信托有限责任公司简称“平安信托”于2015年1月6日收到《中国保监会行政处罚决定书》,称平安信托在经营过程中存在挪用保险资金、违规向关联方提供融资、违规向关联方提供担保等违法行为,并处以罚款30万元的行政处罚。同时,平安信托还因存在挪用保险资金、违规向关联方提供融资、违规向关联方提供担保等违法行为,被中国保监会依法责令改正,并处以罚款30万元的行政处罚。本公司将密切关注该事项的进展,并根据相关法律法规的规定履行信息披露义务。

55.报告期内本基金投资的前十名证券的名称及其在基金资产中的占比

56.报告期内本基金投资的前十名行业分类

57.期末持有的处于转股期的可转换债券情况

58.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的前十名股票

59.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的前五名债券

60.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的前十名资产支持证券

61.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的前五名贵金属

62.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的其他金融工具

63.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的卖出回购金融资产

64.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的买入返售金融资产

65.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的应收款项

66.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的其他应收款

67.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的存货

68.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的递延所得税资产

69.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的其他资产

70.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的负债

71.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的实收基金

72.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的资本公积

73.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的盈余公积

74.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的未分配利润

75.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的负债

76.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的实收基金

77.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的资本公积

78.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的盈余公积

79.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的未分配利润

80.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的负债

81.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的实收基金

82.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的资本公积

83.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的盈余公积

84.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的未分配利润

85.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的负债

86.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的实收基金

87.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的资本公积

88.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的盈余公积

89.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的未分配利润

90.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的负债

91.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的实收基金

92.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的资本公积

93.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的盈余公积

94.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的未分配利润

95.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的负债

96.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的实收基金

97.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的资本公积

98.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的盈余公积

99.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的未分配利润

100.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的负债

101.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的实收基金

102.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的资本公积

103.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的盈余公积

104.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的未分配利润

105.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的负债

106.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的实收基金

107.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的资本公积

108.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的盈余公积

109.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的未分配利润

110.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的负债

111.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的实收基金

112.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的资本公积

113.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的盈余公积

114.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的未分配利润

115.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的负债

116.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的实收基金

117.期末按公允价值占基金总资产的比例排序列出的资本公积