

# 鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金管理 [2015]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:招商银行股份有限公司  
报告送出日期:2015年10月27日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会在报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质性、准确性、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人招行银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月22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，复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺诚实守信、勤勉尽责地管理基金资产，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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

§ 2 基金产品概况

本报告所载财务数据未经审计。

本报告告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期:2015年7月1日 - 2015年9月30日

1.本期已实现收益 -400,001,463.61

2.本期利润 -622,620,421.01

3.期初至报告期末的利润 -10,423,006,202.56

4.期末基金资产净值 69,091,017,000.00

5.期末基金份额净值 0.8944

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)，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.1 主要财务指标

报告期:2015年7月1日 - 2015年9月30日

主要财务指标

1.本期已实现收益 -400,001,463.61

2.本期利润 -622,620,421.01

3.期初至报告期末的利润 -10,423,006,202.56

4.期末基金资产净值 69,091,017,000.00

5.期末基金份额净值 0.8944

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)，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.2 主要财务指标

报告期:2015年7月1日 - 2015年9月30日

主要财务指标

1.本期已实现收益 -400,001,463.61

2.本期利润 -622,620,421.01

3.期初至报告期末的利润 -10,423,006,202.56

4.期末基金资产净值 69,091,017,000.00

5.期末基金份额净值 0.8944

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)，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.3 主要财务指标

报告期:2015年7月1日 - 2015年9月30日

主要财务指标

1.本期已实现收益 -400,001,463.61

2.本期利润 -622,620,421.01

3.期初至报告期末的利润 -10,423,006,202.56

4.期末基金资产净值 69,091,017,000.00

5.期末基金份额净值 0.8944

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)，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.4 主要财务指标

报告期:2015年7月1日 - 2015年9月30日

主要财务指标

1.本期已实现收益 -400,001,463.61

2.本期利润 -622,620,421.01

3.期初至报告期末的利润 -10,423,006,202.56

4.期末基金资产净值 69,091,017,000.00

5.期末基金份额净值 0.8944

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)，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.5 主要财务指标

报告期:2015年7月1日 - 2015年9月30日

主要财务指标

1.本期已实现收益 -400,001,463.61

2.本期利润 -622,620,421.01

3.期初至报告期末的利润 -10,423,006,202.56

4.期末基金资产净值 69,091,017,000.00

5.期末基金份额净值 0.8944

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)，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.6 主要财务指标

报告期:2015年7月1日 - 2015年9月30日

主要财务指标

1.本期已实现收益 -400,001,463.61

2.本期利润 -622,620,421.01

3.期初至报告期末的利润 -10,423,006,202.56

4.期末基金资产净值 69,091,017,000.00

5.期末基金份额净值 0.8944

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)，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.7 主要财务指标

报告期:2015年7月1日 - 2015年9月30日

主要财务指标

1.本期已实现收益 -400,001,463.61

2.本期利润 -622,620,421.01

3.期初至报告期末的利润 -10,423,006,202.56

4.期末基金资产净值 69,091,017,000.00

5.期末基金份额净值 0.8944

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)，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.8 主要财务指标

报告期:2015年7月1日 - 2015年9月30日

主要财务指标

1.本期已实现收益 -400,001,463.61

2.本期利润 -622,620,421.01

3.期初至报告期末的利润 -10,423,006,202.56

4.期末基金资产净值 69,091,017,000.00

5.期末基金份额净值 0.8944

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)，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.9 主要财务指标

报告期:2015年7月1日 - 2015年9月30日

主要财务指标

1.本期已实现收益 -400,001,463.61

2.本期利润 -622,620,421.01

3.期初至报告期末的利润 -10,423,006,202.56

4.期末基金资产净值 69,091,017,000.00

5.期末基金份额净值 0.8944

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)，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.10 主要财务指标

报告期:2015年7月1日 - 2015年9月30日

主要财务指标

1.本期已实现收益 -400,001,463.61

2.本期利润 -622,620,421.01

3.期初至报告期末的利润 -10,423,006,202.56

4.期末基金资产净值 69,091,017,000.00

5.期末基金份额净值 0.8944

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)，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.基金净值表现

3.11 主要财务指标

报告期:2015年7月1日 - 2015年9月30日

主要财务指标

1.本期已实现收益 -400,001,463.61

2.本期利润 -622,620,421.01

3.期初至报告期末的利润 -10,423,006,202.56

4.期末基金资产净值 69,091,017,000.00

5.期末基金份额净值 0.8944

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