鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金

【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:中国建设银行股份有限公司
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,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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华证券分级
场内简称	券商指基
基金主代码	160633
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月6日
报告期末基金份额总额	833,890,231.98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。 本基金力争鹏华证券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。
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率×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。
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
下属分级基金简称	券商指基 / 券商A级 / 券商B级
下属分级场内简称	券商指基 / 券商A级 / 券商B级
下属分级基金交易代码	160633 / 150235 / 150236
下属分级基金报告期末基金份额总额	292,365,214.98份 / 270,762,508.00份 / 270,762,508.00份
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基金份额持有人谋求最大利益。 鹏华证券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。 鹏华证券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。

§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(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-648,096,820.89
2.本期利润	-333,646,750.09
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2461
4.期末基金资产净值	555,633,120.60
5.期末基金份额净值	0.666

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。

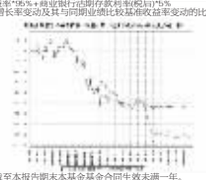
3.2 基金净值表现

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	-19.47%	2.02%	-41.99%	4.37%	22.52%	-2.35%

注:业绩比较基准=中证全指证券公司指数收益率*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2015年5月6日生效,截至本报告期末本基金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,于本基金建仓期结束时(2015年11月6日)起至今,本基金的各项投资比例均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	2015年5月6日	-	8	余斌先生,国籍中国,经济学硕士,8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,先后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月起至今兼任鹏华中证500证券保险指数分级证券投资基金基金经理,2014年11月起至今兼任鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金经理,2015年4月起兼任鹏华中证酒指数分级证券投资基金基金经理,2015年5月起兼任鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理,2015年6月起兼任鹏华中证环保产业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,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。本报告期内未发生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%的情况。

4.4 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

报告期内,基金运作严格按照基金合同的各项要求,依据被动化指数投资方法进行投资管理。

报告期内,投资管理遇到急剧的行情变化和频繁的申购赎回带来的严峻考验,基金经理有针对性地提出了应对方案,较好实现了基金运作目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末,基金份额净值为1.004元,累计净值1.599元。本报告期基金份额净值增长率为-37.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在较长一段时期内,市场走势将受两方面的力量所制衡。一方面,经济增速下滑的现实已被广泛接受,并得到宏观和微观层面经济数据的交叉验证。采用整体法下的企业盈利增速势必降低;另一方面,广义的投资谱中各项资产预期回报率发生较大变化。在实体经济所要求投资回报率下降的背景下,股票资产的配置价值和吸引力相对提高,并且在居民资产配置中的比例还有很大提升空间。前者有助于我们对市场上涨的级别和时间维度有所认识,后者有助于我们认识证券市场的长期投资价值。当两者力量对比较为均衡时,市场大概率将呈现震荡走势。

在经济转型背景下,信息技术领域是经济发展的重点领域,承载着信息化、现代化、智能化产业升级与转型使命。由于板块在报告期内经历大幅下跌,展望四季度,仍然具备很好的投资价值。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注:无。

§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	54,800,511.12	9.75
	其中:股票	54,800,511.12	9.75
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	505,770,102.23	90.01
7	其他资产	1,319,436.15	0.23
8	合计	561,890,049.50	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	54,800,511.12	9.86
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	54,800,511.12	9.86

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	000712	锦龙股份	671,200	10,698,928.00	1.93
2	600837	海通证券	548,574	6,994,318.50	1.26
3	600030	中信证券	465,582	6,322,603.56	1.14
4	601688	华泰证券	222,100	3,091,632.00	0.56
5	000776	广发证券	200,600	2,627,860.00	0.47
6	000166	申万宏源	302,162	2,592,549.96	0.47
7	600999	招商证券	157,473	2,524,292.19	0.45
8	601377	兴业证券	282,000	2,208,060.00	0.40
9	000783	长江证券	225,102	2,086,695.54	0.38
10	601901	方正证券	279,000	1,771,650.00	0.32

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:本基金本报告期内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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以规避风险为目的,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。

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

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10.2 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

注: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.广发证券

本组合投资的前十名证券之一广发证券股份有限公司(以下简称"广发证券")在中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")2014年四季度再融检查时,存在内不符合条件的客户融资融券、违规为到期融资融券合约展期问题,且涉及客户数量较多,受到采取责令改正的行政监管措施。2015年8月24日,广发证券收到中国证监会《调查通知书》(鄂证调查字2015023号)。因涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证监会决定对广发证券立案调查。2015年9月10日,广发证券收到中国证监会《行政处罚事先告知书》(处罚字[2015]71号)。根据《告知书》,广发证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条,《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条,《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第二条第(四)项,《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为。中国证监会对广发证券责令整改,给予警告,没收违法所得6,805,135.75元,并处以20,415,407.25元罚款。

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广发证券,认为本次行政处罚对该证券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和控制跟踪误差,按照成份股权重进行配置该证券,符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

2.海通证券

本组合投资的前十名证券之一海通证券股份有限公司(以下简称"海通证券")于2015年9月10日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"证监会")《行政处罚事先告知书》(处罚字[2015]73号)(以下简称《告知书》)。根据《告知书》,海通证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条,《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条,《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第二条第(四)项,《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为。中国证监会对海通证券责令改正,给予警告,没收违法所得28,653,000元,并处以86,059,000元罚款。

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海通证券,认为本次行政处罚对该证券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和控制跟踪误差,按照成份股权重进行配置该证券,符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

3.华泰证券

本组合投资的前十名证券之一华泰证券股份有限公司(以下简称"华泰证券")于2015年9月10日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"证监会")《行政处罚事先告知书》(处罚字[2015]72号)(以下简称《告知书》)。根据《告知书》,华泰证券未按照《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条,《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为。中国证监会对华泰证券责令改正,给予警告,没收违法所得18,236,275.00元,并处以54,705,825.00元罚款。

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华泰证券,认为本次行政处罚对该证券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和控制跟踪误差,按照成份股权重进行配置该证券,符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

4.长江证券

本组合投资的前十名证券之一的长江证券股份有限公司(以下简称"长江证券")于2015年5月6日受到中国证监会对长江证券相关研究报告的制作、审批和发布等情况的合规性核查。从检查情况看,媒体转载内容未源于5月4日长江证券发布的题为《上证综交可上1.4万亿,创业板已达巅峰——从交易量本看当前市场系列之二》的研究报告。检查中发现,长江证券未与转载机构签订协议,未明确转载责任,致使转载机构篡改了研究报告标题;研报报送审核人员不符合公司内部规定,未能严格执行其内部管理制度。上述行为反映出公司内部控制制度未能有效执行,并违反了中国证监会《发布证券研究报告暂行规定》(证监会公告[2010]28号)第二十一条,"证券公司、证券投资咨询机构投权其他机构刊载或者转发证券研究报告或者摘要,应当与相关机构作出协议约定,明确刊载或者转发责任"之规定。根据《发布证券研究报告暂行规定》(证监会公告[2010]5号)第二十一条的规定,中国证监会对长江证券采取了出具警示函的行政监管措施。根据长江证券公告,长江证券已按照相关规定和中国证监会的要求,采取了措施,严格执行内部控制制度,加强研报刊载或者转发管理,确保业务开展依法合规。

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长江证券,认为本次行政监管措施对该证券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和控制跟踪误差,按照成份股权重进行配置该证券,符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

5.方正证券

本基金投资的前十名证券之一的方正证券股份有限公司(以下简称"方正证券")于2015年1月30日收到中国证监会湖南监管局《关于对方正证券股份有限公司采取责令改正等监管措施的决定》(2015]9号)及其下属机构上海证券交易所等处分的表决方式,审议通过了《方正证券股份有限公司与中国民族证券有限责任公司股东发行股份购买资产协议》,该协议约定:"本次重大资产重组交易完成后,方正证券将根据其内部治理规则及决策机制适时召开股东大会重新选举董事会";同时审议通过了《方正证券股份有限公司发行股份购买资产报告书》,该报告书披露:"本次交易完成后,方正证券将根据其内部治理规则及决策机制适时召开股东大会进行必要的董事会、监事会改选工作"。《决议》将此方正证券有关各方未就执行上市公司股东大会决议达成共识,并且出现了治理结构不健全、内部控制不完善的情况。《决议》还指出,方正证券自2015年第二次临时股东大会的通知),但该次股东大会前提条件已不存在且没有审议事项,方正证券未及时发布取消公告,违反了《公司法》第一百零二条的规定。《决定》责令方正证券取消2015年第二次临时股东大会;责令方正证券在2015年2月16日前改选第二届董事会全部董事和第二届监事会全部非职工代表监事,改选董事、监事的股东大会由有权召集股东大会的主体依法依规召集;责令方正证券董事、监事和董事会秘书勤勉尽责,切实负责或配合做好召开股东大会的各项工作。方正证券于7月14日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"证监会")《调查通知书》(鄂证调查字2015036号)。因公司涉嫌未披露控股股东与其他股东间关联关系等信息披露违法违规,证监会根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,决定对公司立案调查。方正证券全资子公司中国民族证券有限责任公司(以下简称"民族证券")及其相关高级管理人员于2015年7月24日分别收到中国证券监督管理委员会北京监管局(以下简称"北京证监局")下发的《关于对中国民族证券有限责任公司采取限制业务活动、暂停核准业务申请以及建责措施的决定》(【2015】48号)、《关于对中国民族证券有限责任公司财务总监杨英采取通报批评措施的决定》(【2015】47号)、《关于对中国民族证券有限责任公司合规总监蔡晓昕采取建责措施的决定》(【2015】45号)和《关于对中国民族证券有限责任公司副总经理何东采取建责措施的决定》(【2015】44号)。主要内容包括:一、按照《证券公司监督管理条例》第70条,《证券公司风险控制指标管理办法》第38条的规定,北京证监局对民族证券实施以下监管措施:1.暂停民族证券证券自营业务(固定收益证券自营除外)、暂停概念股承销业务的申请;2.暂停概念股承销业务的申请;3.责令民族证券于以通知,北京证监局将在网站上公开披露。二、按照《证券公司监督管理条例》第70条的规定,北京证监局对民族证券董事长赵大建、财务总监杨英、合规总监蔡晓昕、副总经理何东均采取以下行政监管措施:通过北京证监局官方网站,对其予以谴责。方正证券于2015年9月10日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"证监会")《行政处罚事先告知书》(处罚字【2015】74号)(以下简称《告知书》),根据《告知书》,公司未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条,《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条,《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第三条第(四)项,《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为。中国证监会对方正证券责令改正,给予警告,没收违法所得8,717,089.13元,并处以17,434,178.26元罚款。

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方正证券,认为本次行政监管措施对该证券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和控制跟踪误差,按照成份股权重进行配置该证券,符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

6.兴业证券

本基金投资的前十名证券之一的兴业证券股份有限公司(以下简称"兴业证券")于2015年5月9日发布《兴业证券股份有限公司关于最近五年被证券监管部门和交易所采取监管措施或处罚的情况以及相应整改措施的公告》(以下简称《公告》)。《公告》称,经自查,兴业证券公司在最近五年内不存在被证券监管部门和交易所采取监管措施或处罚的情形。公司的控股子公司兴业证券基金管理有限公司(以下简称"兴业基金")和兴证期货有限公司(以下简称"兴证期货")在最近五年存在被相关监管部门或行业自律性组织采取监管措施的情形。(1)兴业基金于2013年5月24日收到中国证监会上海监管局下发的2013113号行政监管措施决定书《关于对兴业基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》。兴业基金在聘任关业务负责人、基金经理过程中违反了《证券投资基金运作管理办法》第八条的规定,被监管机构责令于2013年5月30日前予以改正。经整改,兴业基金对事件发生过程中的责任原因进行认真总结,深刻反省,并对相关责任人进行责任追究,进一步加强内控制度管理,强化业务人员合规培训机制。(2)兴业基及其全资子公司上海兴业睿众资产管理有限公司(以下简称"兴业睿众")于2015年2月15日收到中国证券投资基金业协会下发的2015113号纪律处分决定书,纪律处分决定书认为兴业睿众旗下资产管理计划在参与大宗交易时存在异常情形,而未引起兴业基金足够警觉,进行内控核查,经整改,兴业睿众对该事项进行了整改说明和报送。(3)兴证期货于2014年6月18日收到中国证监会大连监管局下发的2014115号行政监管措施决定书《关于对兴证期货有限公司采购责令整改措施的决定》,对营业席位工作人员《期货从业人员管理办法》违规操作客户账户进行期货交易提出了整改说明和要求。经整改,兴证期货对该问题高度重视,组织人员进行合规培训,梳理和完善公司内控制度,切实防范风险,采取有效措施加强从业人员执业行为管理,有效执行回避关系审核流程,并对违反规定人员采取零容忍。

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,认为兴业证券是国内证券行业的好证券,经营稳健,发展势头良好。兴业证券的自查报告显示,兴业证券公司不存在受监管处罚情形,对兴业证券的财务状况及经营成果并不产生实质性影响。本基金为指数基金,为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差,对该证券的投资按照指数成份股权重进行配置,符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程,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的其他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	987,701.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	99,437.53
5	应收申购款	205,464.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	26,832.84
8	其他	-
9	合计	1,319,436.15

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

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	000712	锦龙股份	10,698,928.00	1.93	重大事项

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

序号				
				券商指基
报告期期初基金份额总额				
报告期期间基金总申购份额				
减:报告期期间基金总赎回份额				
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		292,365,214.98		270,762,508.00

§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)《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金2015年度第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层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区闹市口大街1号院1号楼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
2015年10月27日

鹏华中证新能源指数分级证券投资基金

【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。

基金托管人招商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,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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华新能源分级		
场内简称	新能源		
基金主代码	160640		
交易代码	160640		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年6月29日		
报告期末基金份额总额	82,166,408.54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。 本基金力争鹏华新能源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。		
业绩比较基准	中证新能源指数收益率×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。		
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		
下属分级基金简称	新能源	新能源A	新能源B
下属分级场内简称	新能源	新能源A	新能源B
下属分级基金交易代码	160640	150279	150280
下属分级基金报告期末基金份额总额	50,985,266.54份	15,590,571.00份	15,590,571.00份
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。	鹏华新能源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。	鹏华新能源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。

§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(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-145,012,042.67
2.本期利润	-87,698,084.10
3.加权平均基金份额本期利润	-0.6459
4.期末基金资产净值	67,639,527.12
5.期末基金份额净值	0.823

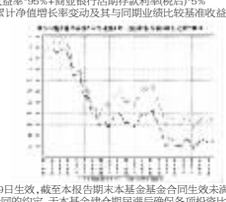
3.2 基金净值表现

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	-39.11%	4.40%	-25.89%	4.15%	-13.22%	0.25%

注:业绩比较基准=中证新能源指数收益率*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2015年5月29日生效,截至本报告期末本基金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。

§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		
焦文龙	本基金基金经理	2015年5月29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月起担任鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理,2015年5月起兼任鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理,2015年5月起兼任鹏华中证新能源指数分级证券投资基金基金经理,2015年7月起兼任鹏华新丝路指数分级证券投资基金、鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金经理。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未发生变动。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。本报告期内未发生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%的情况。

4.4 报告期内基金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

本基金来源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0.8223元,累计净值0.480元。本报告期基金份额净值增长率为-39.11%。

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年以来,经济下行预期明确,但证券市场在改革预期激发、杠杆资金推动下,年初大幅上行;6月以来随着预期透支、杠杆清理,大幅回落。

展望未来,宏观经济超预期向下可能性较