

## 鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金

[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  
报告送达日期: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基金合同约定，于2015年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策等，并保证复核结果与本基金实际情况相符、一致。

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。投资人投资于基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	鹏华沪深300ETF
场内简称	A300ETF
基金主代码	159927
交易代码	159927
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年7月1日
报告期末基金份额总额	10,192,168,000份
投资目标	紧密跟踪标的指数,求取回报幅度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法,按照标的指数在标的指数中的基准权重构造指数型投资组合,并根据标的指数成分股及其权重的变动进行相应调整。 当标的指数成份股发生增减或变更时,基金管理人将根据指数编制机构发布的方案和有关公告,对基金投资组合进行相应调整;如果指数编制机构未在规定期限内作出调整,或者某些特殊情况下无法及时调整时,或其他原因导致无法有效复效指数的规则时,基金管理人可以对投资组合进行适当调整,以降低跟踪误差。
业绩比较基准	沪深300指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,其风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为避险策略基金的较低风险、投资风格稳健的品种。 本基金投资于股票的比例不低于基金资产的90%,投资于沪深300指数成分股的比例不低于非现金基金资产的80%。
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

## § 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.本期应收股息	2,560,438.67
2.本期利润	-14,280,264.60
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1301
4.期末基金资产净值	33,022,526.19
5.期末基金份额总额	32,940,000份

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,本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。  
2.所列期间基金业报酬包括持有人从认购、申购(认沽)到赎回(卖出)时所支付的申购费、赎回费、赎回金额的计算公式等。

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率与同期行业比较基准收益率变动的比较

## 基金业报酬率与沪深300指数、深证成指、上证综指、中小板指、创业板指、上证50指数

## 与基金业报酬率与沪深300指数、深证成指、上证综指、中小板指、创业板指、上证50指数

## 与基金业报酬率与沪深300指数、深证成指、上证综指、中小板指、创业板指、上证50指数