

鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金管理

[2015]第四季度报告

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:2016年1月21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约定，于2016年1月18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。
本报告告期无财务费用。

报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2基金产品概况

基金简称	鹏华环保分级
场内简称	环保分级
基金代码	160634
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年10月16日
报告期末基金份额总额	193,167,047.63份
投资目标	紧密跟踪标的指数，为投资者提供便捷的投资工具，力争将均回报率与标的指数表现相一致。
投资策略	本基金采取完全复制法，按照行业分类在标的指数的基准权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当标的指数成份股发生增减或变更时，根据指数编制机构的公告，对股票投资组合进行相应调整，同时，根据某只股票因政策限制无法买卖或影响到投资组合的正常运行时，基金管理人可以以投资组合合理调整为由适当调整和调整，力求降低跟踪误差。 本基金主要跟踪环保行业指数，通过投资于该行业成份股，力求在风险调整后收益超越上述平均水平。基金管理人应按照管理费率收取相应的风险报酬率。
业绩比较基准	中证环保行业指数收益率×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，其预期的风险收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中的较高风险，具有较高的预期收益，同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险和收益特征。
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
下属分级基金的名称	鹏华环保A 鹏华环保B
下属分级基金的场内简称	环保分级 环保分级
下属分级基金的交易代码	160634 160634
下属分级基金的报告期	160634 160634
基金资产净值	13,787,275.00份 13,787,275.00份

§ 3主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2015年10月1日～2015年12月31日)
1.本期利润	-9,640,459.97
2.本期利润除权后变动	51,331,764.37
3.本期末基金资产净值	249,121,666.00
4.本期末基金份额净值	1.2794

注:1.本期已实现收益指基金利润收入、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，本期利润为期初至报告期末的累计利润减去本期公允价值变动收益；

2.所述基金业绩报酬不包括任何从认购或交易本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列示。

3.本基金净值表现不适用于任何认购或交易本基金的客户。

3.21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值

阶段	净值增长率为	净值增长长期标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	(1)-(3)	(2)-(4)
过去三个月	25.15%	2.00%	21.95%	1.55%	3.20%	0.16%

注:业绩比较基准=中证环保行业指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%

3.22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:本基金合同生效以来，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

3.23本基金合同生效以来基金净值表现

注:本基金合同生效以来，基金净值表现未满一年。

2.截至报告期末，本基金的净资产比例与合同约定的规定的各项比例

3.4管理人报告

4.1基金基本情况(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理	任职日期	离任日期	说明
余斌	本基金基金经理	余斌	2016年6月16日	-	余斌先生，中国国籍，经济学硕士，现为基金管理人，担任鹏华基金管理有限公司，担任风控控制部宏观研究组分析师，历任鹏华基金管理有限公司，历任风控控制部大客户经理，量化投资部量化研究员，之后历任特富客户经理，2014年5月起担任鹏华量化基金基金经理，2014年5月起担任鹏华量化基金基金经理，2015年6月起担任鹏华量化基金基金经理，2015年6月起兼任鹏华环保分级基金经理。

5.1.1基金投资的前十名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。

5.1.2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。

5.1.3其他资产构成

注:1.本基金合同于2015年6月16日生效，截至本报告期末本基金合同尚未满一年。

2.截至报告期末，本基金的净资产比例与合同约定的规定的各项比例

3.4管理人报告

4.1基金的基本情况

4.2.1本公司所管理的基金品种

4.2.2本公司所管理的基金品种

4.2.3本公司所管理的基金品种

4.2.4本公司所管理的基金品种

4.2.5本公司所管理的基金品种

4.2.6本公司所管理的基金品种

4.2.7本公司所管理的基金品种

4.2.8本公司所管理的基金品种

4.2.9本公司所管理的基金品种

4.2.10本公司所管理的基金品种

4.2.11本公司所管理的基金品种

4.2.12本公司所管理的基金品种

4.2.13本公司所管理的基金品种

4.2.14本公司所管理的基金品种

4.2.15本公司所管理的基金品种

4.2.16本公司所管理的基金品种

4.2.17本公司所管理的基金品种

4.2.18本公司所管理的基金品种

4.2.19本公司所管理的基金品种

4.2.20本公司所管理的基金品种

4.2.21本公司所管理的基金品种

4.2.22本公司所管理的基金品种

4.2.23本公司所管理的基金品种

4.2.24本公司所管理的基金品种

4.2.25本公司所管理的基金品种

4.2.26本公司所管理的基金品种

4.2.27本公司所管理的基金品种

4.2.28本公司所管理的基金品种

4.2.29本公司所管理的基金品种

4.2.30本公司所管理的基金品种

4.2.31本公司所管理的基金品种

4.2.32本公司所管理的基金品种

4.2.33本公司所管理的基金品种

4.2.34本公司所管理的基金品种

4.2.35本公司所管理的基金品种

4.2.36本公司所管理的基金品种

4.2.37本公司所管理的基金品种

4.2.38本公司所管理的基金品种

4.2.39本公司所管理的基金品种

4.2.40本公司所管理的基金品种

4.2.41本公司所管理的基金品种

4.2.42本公司所管理的基金品种

4.2.43本公司所管理的基金品种

4.2.44本公司所管理的基金品种

4.2.45本公司所管理的基金品种

4.2.46本公司所管理的基金品种

4.2.47本公司所管理的基金品种

4.2.48本公司所管理的基金品种

4.2.49本公司所管理的基金品种

4.2.50本公司所管理的基金品种

4.2.51本公司所管理的基金品种

4.2.52本公司所管理的基金品种

4.2.53本公司所管理的基金品种

4.2.54本公司所管理的基金品种

4.2.55本公司所管理的基金品种

4.2.56本公司所管理的基金品种

4.2.57本公司所管理的基金品种

4.2.58本公司所管理的基金品种

4.2.59本公司所管理的基金品种

4.2.60本公司所管理的基金品种

4.2.61本公司所管理的基金品种

4.2.62本公司所管理的基金品种

4.2.63本公司所管理的基金品种

4.2.64本公司所管理的基金品种

4.2.65本公司所管理的基金品种

4.2.66本公司所管理的基金品种

4.2.67本公司所管理的基金品种

4.2.68本公司所管理的基金品种

4.2.69本公司所管理的基金品种

4.2.70本公司所管理的基金品种

4.2.71本公司所管理的基金品种

4.2.72本公司所管理的基金品种

4.2.73本公司所管理的基金品种

4.2.74本公司所管理的基金品种

4.2.75本公司所管理的基金品种

4.2.76本公司所管理的基金品种

4.2.77本公司所管理的基金品种

4.2.78本公司所管理的基金品种

4.2.79本公司所管理的基金品种

4.2.80本公司所管理的基金品种

4.2.81本公司所管理的基金品种

4.2.82本公司所管理的基金品种

4.2.83本公司所管理的基金品种

4.2.84本公司所管理的基金品种

4.2.85本公司所管理的基金品种

4.2.86本公司所管理的基金品种

4.2.87本公司所管理的基金品种

4.2.88本公司所管理的基金品种

4.2.89本公司所管理的基金品种

4.2.90本公司所管理的基金品种

4.2.91本公司所管理的基金品种

4.2.92本公司所管理的基金品种

4.2.93本公司所管理的基金品种

4.2.94本公司所管理的基金品种

4.2.95本公司所管理的基金品种

4.2.96本公司所管理的基金品种

4.2.97本公司所管理的基金品种

4.2.98本公司所管理的基金品种

4.2.99本公司所管理的基金品种

4.2.100本公司所管理的基金品种

4.2.101本公司所管理的基金品种

4.2.102本公司所管理的基金品种

4.2.103本公司所管理的基金品种