

# 鹏华中证传媒指数分级证券投资基金

## 【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声明本基金不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质性、准确性、完整性承担责任并承诺连带责任。  
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，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。  
本基金中财网财经网评估。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

### § 2 基金产品概况

基金简称	鹏华传媒分级
场内简称	传媒分级
基金主代码	160620
基金的分级方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年1月11日
报告期末基金份额总额	1,531,132,170.99份
投资目标	紧密跟踪标的指数，实现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±0.3%，年内跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金采用完全复制法或指数增强法，按照行业分类在不同的行业中的基准权重构建指数化投资组合，并根据成份股的派息率或其权值进行再平衡。当期成份股发生分红时，则在分红实施后，或因现金申购和赎回导致基金资产规模变化时，基金管理人将对投资组合进行适当的调整，以确保基金的资产净值增长率尽可能地跟上标的指数的变动，同时基金管理人将通过定期的定期报告向基金持有人披露基金的偏离度和跟踪误差情况。
基金经理	鹏华基金管理有限公司
基金代销机构	中国建设银行股份有限公司
基金管理费	0.50%
基金托管费	0.10%
报告期末总资产	472,990,338.99元
报告期末总负债	361,570,922.00份
报告期末所有者权益	361,570,922.00份

§ 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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-9,331,766.40
2.本期利润	276,401,000.74
3.加权平均基金份额利润率	0.0260
4.期末基金份额净值	1,458,400.1311
5.期末基金份额净值	0.993

注:1.本期利润为收入减去必要的费用后的金额。  
2.本期已实现收益指扣除管理费后的部分，即为可供分配的利润。  
3.本基金所持股票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)，计入产品实际收益水平将低于所列数字。

3.21 本报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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)
过去三个月	33.19%	2.40%	20.19%	2.21%

注:业绩比较基准=中证传媒指数收益率\*95%+商业银行存款利率(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与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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)
过去六个月	33.19%	2.40%	20.19%	2.21%

注:1.本基金合同于2014年12月11日生效。  
2.截至建仓期结束,本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例。

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间	证券从业年限	说明
杨晓杰先生,国籍中国,金融工程专业理学硕士,7年证券从业经验。2008年7月加盟鹏华基金管理有限公司,历任产品规划产品经理、量化投资部研究员、量化投资部基金经理,2013年3月起兼任鹏华深证基本面指数分级基金经理,2014年1月起兼任鹏华中证传媒指数分级基金经理,2014年12月起兼任鹏华中证传媒指数分级基金经理,2015年1月起兼任鹏华中证传媒指数分级基金经理,2015年4月起兼任鹏华中证传媒指数分级基金经理,2015年6月起兼任鹏华中证传媒指数分级基金经理,2015年7月起兼任鹏华中证传媒指数分级基金经理,2015年8月起兼任鹏华中证传媒指数分级基金经理,2015年9月起兼任鹏华中证传媒指数分级基金经理,2015年10月起兼任鹏华中证传媒指数分级基金经理,2015年11月起兼任鹏华中证传媒指数分级基金经理,2015年12月起兼任鹏华中证传媒指数分级基金经理。	杨晓杰	2010年4月 -	12年11月	-

4.2 证券从业的年限

4.3 其他说明

4.4 管理费

4.5 托管费

4.6 基金销售服务费

4.7 其他费用

4.8 其他资产

4.9 其他负债

5. 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.4 报告期末按品种分类的股票投资组合

5.5 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.6 报告期末按品种分类的资产支持证券投资组合

5.7 报告期末按品种分类的贵金属投资组合

5.8 报告期末按品种分类的其他投资组合

5.9 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.10 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.11 报告期末按品种分类的股票投资组合

5.12 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.13 报告期末按品种分类的资产支持证券投资组合

5.14 报告期末按品种分类的贵金属投资组合

5.15 报告期末按品种分类的其他投资组合

5.16 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.17 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.18 报告期末按品种分类的股票投资组合

5.19 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.20 报告期末按品种分类的资产支持证券投资组合

5.21 报告期末按品种分类的贵金属投资组合

5.22 报告期末按品种分类的其他投资组合

5.23 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.24 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.25 报告期末按品种分类的股票投资组合

5.26 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.27 报告期末按品种分类的资产支持证券投资组合

5.28 报告期末按品种分类的贵金属投资组合

5.29 报告期末按品种分类的其他投资组合

5.30 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.31 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.32 报告期末按品种分类的股票投资组合

5.33 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.34 报告期末按品种分类的资产支持证券投资组合

5.35 报告期末按品种分类的贵金属投资组合

5.36 报告期末按品种分类的其他投资组合

5.37 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.38 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.39 报告期末按品种分类的股票投资组合

5.40 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.41 报告期末按品种分类的资产支持证券投资组合

5.42 报告期末按品种分类的贵金属投资组合

5.43 报告期末按品种分类的其他投资组合

5.44 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.45 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.46 报告期末按品种分类的股票投资组合

5.47 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.48 报告期末按品种分类的资产支持证券投资组合

5.49 报告期末按品种分类的贵金属投资组合

5.50 报告期末按品种分类的其他投资组合

5.51 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.52 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.53 报告期末按品种分类的股票投资组合

5.54 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.55 报告期末按品种分类的资产支持证券投资组合

5.56 报告期末按品种分类的贵金属投资组合

5.57 报告期末按品种分类的其他投资组合

5.58 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.59 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.60 报告期末按品种分类的股票投资组合

5.61 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.62 报告期末按品种分类的资产支持证券投资组合

5.63 报告期末按品种分类的贵金属投资组合

5.64 报告期末按品种分类的其他投资组合

5.65 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.66 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.67 报告期末按品种分类的股票投资组合

5.68 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.69 报告期末按品种分类的资产支持证券投资组合

5.70 报告期末按品种分类的贵金属投资组合

5.71 报告期末按品种分类的其他投资组合

5.72 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.73 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.74 报告期末按品种分类的股票投资组合

5.75 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.76 报告期末按品种分类的资产支持证券投资组合

5.77 报告期末按品种分类的贵金属投资组合

5.78 报告期末按品种分类的其他投资组合

5.79 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.80 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.81 报告期末按品种分类的股票投资组合

5.82 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.83 报告期末按品种分类的资产支持证券投资组合