鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）

【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：中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华优质治理混合（LOF）
场内简称	鹏华治理
基金主代码	160611
交易代码	160611
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2007年4月25日
报告期末基金份额总额	1,496,721,143.00份
投资目标	投资于具有相对完善的公司治理结构和良好成长性的优质上市公司，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	（1）股票投资策略：本基金采取“自上而下”的资产配置和“自下而上”的选股策略相结合的主动投资管理策略。整体资产和行业配置主要根据宏观经济、政策环境及行业发展不同阶段、不同特点等情况确定股票投资比例和行业配置比例，个股方面，主要投资于具有相对完善的公司治理结构和良好成长性的优质上市公司，同时关注那些过去基本面较差但正在发生转折的上市公司，采用多种价值评估方法，多视角地进行分析，努力选择最具有投资价值的公司进行投资。 （2）债券投资策略：本基金的债券投资采用久期控制下的主动投资策略，本着风险收益匹配最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的配置比例。在个券选择上，本基金综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用等级分析、流动性评估等方法来评估个券的投资价值。 （3）权证投资策略：本基金将权证看作是辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%＋中证综合债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币型基金、债券基金，低于股票型基金，为证券投资基金中具有中高风险、中高收益的投资品种。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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10月1日 - 2015年12月31日）
1.本期已实现收益	106,693,900.78
2.本期利润	179,728,772.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.1174
4.期末基金资产净值	1,583,290,865.96
5.期末基金份额净值	1.058

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。

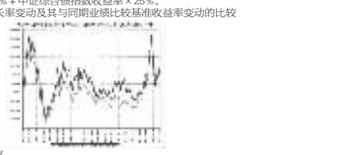
3.2 基金净值表现

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	12.31%	1.17%	12.98%	1.25%	-0.67%	-0.08%

注：业绩比较基准=沪深300指数收益率×75%＋中证综合债指数收益率×25%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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2007年4月25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中规定的各项比例。

§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		
张戈生	本基金基金经理	2014年7月26日	2015年12月4日	8	张戈先生，国籍中国，经济学博士，8年证券从业经验。历任宝盈基金管理有限公司核心研究员，从事策略、地产等研究；2012年5月加盟鹏华基金管理有限公司，担任研究部高级研究员，从事策略研究工作，2014年4月至2014年6月担任鹏华普丰证券投资基金（2014年6月已转型为鹏华策略优选混合基金）基金经理，2014年7月至2015年12月兼任鹏华优质治理混合（LOF）基金经理，2014年6月起担任鹏华策略优选混合基金基金经理。张戈先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，张戈不再担任本基金基金经理，由吴印、胡东健担任本基金基金经理。
吴印	本基金基金经理	2015年2月10日	-	9	吴印先生，国籍中国，经济学硕士，9年证券从业经验。历任万家基金管理有限公司研究发展部行业分析师、基金经理助理、万家双引擎混合基金基金经理、万家行业优选股票基金（LOF）基金经理、万家精选股票基金基金经理等职；现任职于鹏华基金管理有限公司基金管理部，2015年2月起担任鹏华优质治理混合（LOF）基金基金经理，2015年5月起兼任鹏华精选成长混合基金基金经理。吴印先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，张戈不再担任本基金基金经理，由吴印、胡东健担任本基金基金经理。
胡东健	本基金基金经理	2015年12月4日	-	4	胡东健先生，国籍中国，经济学硕士，4年金融证券从业经验。历任融通基金管理有限公司研究员；2015年1月加盟鹏华基金管理有限公司，担任高级研究员，从事投资研究工作，2015年6月起担任鹏华价值精选股票基金基金经理，2015年12月起兼任鹏华优质治理混合型（LOF）基金基金经理。胡东健先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，张戈不再担任本基金基金经理，由吴印、胡东健担任本基金基金经理。

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%的交易次数为1次，主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年四季度中国经济在“稳增长”与“调结构”的背景下，疲弱前行，A股市场在3季度呈现出异常波动后，然后在四季度市场快速恢复到3539点。本基金秉承指数基金的投资策略，在报告期内连续遭遇一定比例申购赎回，对基金净值造成一定影响，管理人尽力降低影响，在力争跟踪指数收益的基础上，将基金跟踪误差控制在合理范围内。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期末，本基金份额净值为1.494元，累计净值1.494元；本报告期基金份额净值增长率为+26.72%，业绩比较基准收益率+23.13%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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	1,033,804,600.83	61.22
	其中：股票	1,033,804,600.83	61.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	426,456,907.94	25.25
8	其他资产	228,501,043.85	13.53
9	合计	1,688,762,552.62	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	44,810,000.00	2.83
B	采矿业	-	-
C	制造业	355,854,852.96	22.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,310,000.00	0.34
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	15,487,709.25	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	12,855,000.00	0.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	143,762,480.97	9.08
J	金融业	239,830,000.00	15.15
K	房地产业	34,245,823.30	2.16
L	租赁和商务服务业	104,038,734.35	6.57
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	20,862,000.00	1.32
R	文化、体育和娱乐业	56,748,000.00	3.58
S	综合	-	-
	合计	1,033,804,600.83	65.29

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	002400	省广股份	4,136,729	104,038,734.35	6.57
2	601318	中国平安	2,500,000	90,000,000.00	5.68
3	002316	键桥通讯	3,499,909	71,013,153.61	4.49
4	300017	网宿科技	1,049,880	62,982,301.20	3.98
5	002475	立讯精密	1,800,000	57,510,000.00	3.63
6	600837	海通证券	3,500,000	55,370,000.00	3.50
7	000890	法尔胜	3,999,965	55,079,518.05	3.48
8	002508	老板电器	1,000,000	44,950,000.00	2.84
9	002321	华英农业	3,000,000	39,630,000.00	2.50
10	002343	禾欣股份	600,000	36,420,000.00	2.30

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投资。

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投资。

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一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投资。

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：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

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

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交易和损益明细

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

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 本基金投资的前十名证券之一的上海证券于2015年8月26日发布公告称其收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》，因公司涉嫌未按规定审查、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，中国证券监督管理委员会决定对公司进行立案调查，2015年9月12日，公司发布公告收到中国证券监督管理委员会《行政处罚事先告知书》，因为海通证券上海建国西路营业部和杭州解放路营业部对杭州恒生网络技术服务有限责任公司HOMS系统开放专线接入，其中第一条专线于2014年3月由零售与网络金融部、信息技术管理部、合规与风险管理总部平行审核后接入上线。第二条专线于2015年2月由零售与网络金融部、合规与风险管理总部、信息技术管理部平行审核后接入上线。对于上述外部接入的第三方交易终端软件，海通证券未进行软件认证许可，未对外部系统接入实施有效管理，对相关客户身份情况缺乏了解，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、《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》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，获利2865.3万元。2015年11月28日，公司公告收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》，因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司进行立案调查。

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，认为海通证券是国内排名靠前的证券机构，2015年资本市场热度较高，公司业绩增长迅速，从处罚公告中知悉，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85,959,000元罚款，而2015年海通的净利润预计超过140亿，此次处罚对海通证券的财务状况及经营成果并不产生实质性影响。本次处罚对该股票的投资价值不产生重大影响，该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，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之一的深圳键桥通讯技术股份有限公司（以下简称“键桥通讯”或“公司”）于2015年2月17日收到中国证券监督管理委员会深圳监管局（以下简称“中国证监会深圳监管局”）《行政处罚决定书》（[2015]1号），具体情况如下：

一、中国证监会《行政处罚决定书》（[2015]1号）

（一）定期报告虚构营业收入、成本以及虚构应收账款项下的事实

键桥通讯虚增收入、成本以及虚构应收账款收回少计提坏账准备合计对当年度利润总额的影响是：虚增2009年利润总额1391万元，占当期披露利润总额的29.35%。虚增2010年利润总额447万元，占当期披露利润总额的9.01%；虚增2011年利润总额551万元，占当期披露利润总额的12.34%；虚增2012年利润总额926万元，占当期披露利润总额的14.36%。

（二）重大对外贷款未及时入账及披露的事实

2013年1月4日，键桥通讯与深圳市天某亿科技发展有限公司签订四份借款协议，金额共计2.55亿元，未经董事会审议。上述对外贷款金额占键桥通讯上年末经审计总资产的15.76%，具有重大性，可能对上市公司股票交易价格产生较大影响，应及时报告并披露，但键桥通讯未针对该借款事项进行临时公告。上述借款事项涉及的资金支付，键桥通讯于2013年1月4日至6日根据协议将资金分别转出，未及时入账确认，截至2013年6月30日，尚未入账的合计111,577,270元，导致公司《2013年半年度报告》货币资金、其他应收款等项目存在虚假记载。

（三）重大对外担保未及时披露的事实

2013年3月26日、4月5日，键桥通讯分别与广某银行深圳分行签订两份《最高额权利质押合同》，约定分别出质金额2,000万元、4,000万元的两份定期存单，作为深圳市优某供应链有限公司合计本金15亿元债务本息的担保，未经董事会审议。上述被担保债务本金总额，占键桥通讯上年末经审计净资产888,411,991.20元的16.88%，具有重大性，可能对上市公司股票交易价格产生较大影响，应及时报告并披露。但键桥通讯未对该事项进行临时公告，也未在《2013年半年度报告》中披露该担保事项。

依据《证券法》规定，上市公司是信息披露义务人。键桥通讯2009年、2010年、2011年、2012年年报及2013年半年报均存在虚假记载或重大遗漏，并存在重大事项未依法及时公告的情形，违反了《证券法》第六十三条的规定，构成了《证券法》第一百九十三条所述的行为。键桥通讯是有关违法行为的责任主体。叶焕、David Xun Ge（葛迅）、李秀红、洪圣恩、徐慧玲为键桥通讯有关违法行为直接负责的主管人员，夏明荣、殷建锋、Brenda Yep（叶冰）、叶恃、李连和、付昭阳、罗飞为其他责任人员。

依据《证券法》第一百九十三条的规定，中国证监会深圳监管局决定：

1、对键桥通讯责令改正，给予警告，并处以六十万元罚款；

2、对叶焕、David Xun Ge（葛迅）分别给予警告，并各处以三十万元罚款；

3、对李秀红给予警告，并处以十万元罚款；

4、对洪圣恩、徐慧玲、夏明荣分别给予警告，并各处以五万元罚款；

5、对Brenda Yep（叶冰）、叶恃分别给予警告，并各处以三万元罚款；

6、对殷建锋、李连和、付昭阳、罗飞分别给予警告。

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，键桥通讯目前已经发布并购预案重换控股股东，并且积极准备上会，同时积极处理应收账款风险，具备较好的投资价值。从监管措施公告中知悉，相关问题对于公司经营并不构成重大实质性影响。对键桥通讯的财务状况及经营成果并不产生重大实质性影响。本次监管措施对该股票的投资价值不产生重大影响。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，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中的其它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	1,203,586.99
2	应收证券清算款	227,209,695.40
3	应收股利	-
4	应收利息	79,557.03
5	应收申购款	8,204.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	228,501,043.85

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 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	1,556,024,207.97
报告期期间基金总申购份额	3,996,705.58
减：报告期期间基金总赎回份额	63,299,770.55
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期末基金份额总额	1,496,721,143.00

§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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	46,794,805.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	46,794,805.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	3.13

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

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末申购、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）《鹏华优质治理股票型证券投资基金（LOF）基金合同》

（二）《鹏华优质治理股票型证券投资基金（LOF）托管协议》

（三）《鹏华优质治理股票型证券投资基金（LOF）2015年第4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

北京市西城区复兴门内大街55号中国工商银行股份有限公司

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

2016年1月21日

鹏华中国50开放式证券投资基金

【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：交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华中国50混合
场内简称	鹏华50
基金主代码	160605
交易代码	160605
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年5月12日
报告期末基金份额总额	912,036,441.43份
投资目标	以价值投资为本，通过集中投资于基本面和流动性良好同时收益价值或成长价值相对被低估的股票，长期持有结合适度波段操作，以求在充分控制风险的前提下分享中国经济成长和实现基金财产的长期稳定增值。
投资策略	（1）股票投资方法：本基金股票投资中，精选个股，长期持有结合适度波段操作，注重长期收益。将类指数的选股方式与积极的权重配置相结合，从而在保持了收益空间的前提下一定程度上降低了投资风险。股票价值分析兼顾收益性和成长性。 （2）债券投资方法：本基金债券投资以降低组合总体波动性从而改善组合风险构成为目的，采取积极主动的投资策略，谋取超额收益。
业绩比较基准	上证180指数涨跌幅×65%＋深证100指数涨跌幅×30%＋金融同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于平衡型证券投资基金，为证券投资基金中的中风险品种。长期平均的风险和预期收益低于成长型基金，高于价值型基金、指数型基金、纯债券基金和国债。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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10月1日 - 2015年12月31日）
1.本期已实现收益	4,658,718.25
2.本期利润	330,323,397.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.3536
4.期末基金资产净值	1,428,246,491.06
5.期末基金份额净值	1.566

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。

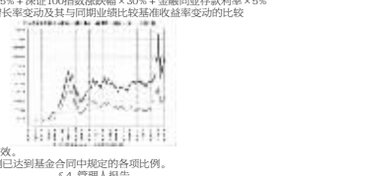
3.2 基金净值表现

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	28.15%	2.33%	16.60%	1.61%	11.55%	0.72%

注：业绩比较基准=上证180指数涨跌幅×65%＋深证100指数涨跌幅×30%＋金融同业存款利率×5%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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2004年5月12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中规定的各项比例。

§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		
陈鹏	本基金基金经理	2011年1月28日	-	12	陈鹏先生，国籍中国，工商管理硕士，12年证券从业经验。曾在联合证券有限责任公司任行业研究员；2006年5月加入鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作，历任行业研究员、鹏华价值优势股票（LOF）基金基金经理助理，2007年8月至2011年1月担任鹏华行业成长证券基金基金经理，2008年8月至2011年5月担任鹏华普丰基金基金经理，2011年6月至2013年3月担任鹏华新兴产业混合基金基金经理，2013年1月至2014年4月担任鹏华普丰基金基金经理，2011年1月起担任鹏华中国50混合基金基金经理，2015年5月起兼任鹏华消费领先混合基金基金经理。现同时担任权益投资二部副总经理、投资决策委员会成员。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

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%的交易次数为1次，主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年四季度中国经济在“稳增长”与“调结构”的背景下，疲弱前行，A股市场在3季度呈现出异常波动后，然后在四季度市场快速恢复到3539点。本基金秉承指数基金的投资策略，在报告期内连续遭遇一定比例申购赎回，对基金净值造成一定影响，管理人尽力降低影响，在力争跟踪指数收益的基础上，将基金跟踪误差控制在合理范围内。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期末，本基金份额净值为1.494元，累计净值1.494元；本报告期基金份额净值增长率为+26.72%，业绩比较基准收益率+23.13%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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）	占基金资产净值比例（%）
1	权益投资	1,337,996,211.00	90.43
	其中：股票	1,337,996,211.00	90.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	40,092,000.00	2.71
	其中：债券	40,092,000.00	2.71
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	70,069,378.47	4.74
8	其他资产	31,464,862.37	2.13
9	合计	1,479,622,451.84	100.00

5.2 报告期末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	738,747,131.71	51.72
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	72,952,705.20	5.11
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	206,977,960.30	14.49
J	金融业	-	-
K	房地产业	125,357,559.06	8.78
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	18,439,918.05	1.29
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	115,703,700.00	8.10
S	综合	59,817,246.68	4.19
	合计	1,337,996,211.00	93.68

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	600880	博瑞传播	349,000	3,961,150.00	1.11
2	600289	亿阳信通	135,807	2,675,397.90	0.75
3	600816	安信信托	108,408	2,468,450.16	0.69
4	600894	广日股份	105,662	2,112,183.38	0.59
5	000718	苏宁环球	146,060	1,926,531.40	0.54
6	600635	大众公用	192,387	1,896,935.82	0.53
7	600201	生物股份	49,200	1,818,924.00	0.51
8	600435	北方导航	60,386	1,733,078.20	0.49
9	002466	天齐锂业	12,300	1,731,225.00	0.48
10	600835	上海机电	56,446	1,710,878.26	0.48

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

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	000982	中银绒业	112,858	988,636.08	0.28
2	002018	华信国际	29,500	902,700.00	0.25
3	002091	江苏国泰	13,150	349,395.50	0.10

注：上述股票明细为本基金本报告期末持有的积极投资的全部股票。

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：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

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

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

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 本基金投资的前十名证券之一的内蒙古金宇集团股份有限公司（以下简称“公司”）第八届董事会第十五次会议及公司2015年第一次临时股东大会审议通过了公司非公开发行股票的相关议案。2015年8月14日，公司收到证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）出具的《中国证监会行政许可申请受理通知书》。2015年11月23日，公司收到中国证监会出具的《中国证监会行政许可项目审查反馈意见通知书》（152501号）。目前，公司非公开发行正处于反馈阶段，根据反馈意见要求，现将公司最近五年来证券监管部门和交易所对公司现场检查和监管过程中发现的问题以及公司整改相关情况公告。今后，公司将严格按照《公司法》、《证券法》及中国证监会、上海证券交易所的规范性文件和要求，不断完善公司法人治理，提高公司规范运作水平，保证公司持续、健康、稳定的发展。

2015年6月1日，公司及董事长张翀宇、董事会秘书李树剑收到上海证券交易所上证公监函[2015]0030号《关于对内蒙古金宇集团股份有限公司和有关责任人予以监管关注的决定》（以下简称《决定》）。内容如下：

“2014年10月12日、10月30日，内蒙古金宇集团股份有限公司（以下简称金宇集团或公司）分别召开董事会和股东大会，审议通过了关于非公开发行股票相关议案。2015年4月28日、4月29日，公司相继披露了关于终止2014年度非公开发行股票申请的公告及补充公告。公告中称，公司与保荐机构协商一致，决定终止本次非公开发行股票申请，并于4月20日向中国证监会提交了终止本次非公开发行的申请。4月24日，公司收到中国证监会同意公司撤回申请的书面文件。

经查明，公司董事、高级管理人员已于2015年4月17日就终止本次非公开发行股票申请事项口头达成一致意见，但公司未履行信息披露义务。4月20日，公司向中国证监会提交撤回申请，公司亦未及时履行信息披露义务，并迟至收到中国证监会的有关终止审查通知书后，才于4月28日、4月29日对外披露该事项。

本次终止非公开发行股票事宜，属于对公司股价可能产生较大影响的重大事件，且终止非公开发行股票的进程中，公司股票一直处于交易状态，公司应当严格按照《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称“《股票上市规则》”）的规定，及时履行信息披露义务。金宇集团未及时披露该信息，违反了《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称“《股票上市规则》”）第2.1条、第2.3条、第7.