

## 鹏华环保产业股票型证券投资基金

## [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法律法规的有关规定，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。

基金过往业绩并不代表未来表现，投资人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：鹏华环保产业股票

基金场内简称：鹏华环保产业股票

基金代码：000409

交易方式：场外

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014年9月1日

报告期末基金份额总额：367,520,521.01份

基金资产净值：100.000

投资目标：在有效控制风险的前提下，精选优质的环保产业上市公司，力求超越收益

投资策略：1. 资产配置策略：本基金将对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、海外市场等进行深入分析，从而对本基金的资产配置比例进行动态调整。本基金将通过大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，运用定性和定量的手段，定期或不定期地调整资产配置比例，以求在风险、收益、费率等大类资产之间的配置比例、调期策略和资产配置比例的优化。

2. 行业配置策略：本基金将根据对各行业的研究，择优选择具有投资价值的行业进行配置。

3. 个股选择策略：本基金将根据对上市公司的研究，精选具有投资价值的个股进行配置。

4. 投资组合管理：本基金将根据对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、海外市场等进行深入分析，从而对本基金的资产配置比例进行动态调整。本基金将通过大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，运用定性和定量的手段，定期或不定期地调整资产配置比例，以求在风险、收益、费率等大类资产之间的配置比例、调期策略和资产配置比例的优化。

5. 基金投资组合管理：本基金将根据对各行业的研究，择优选择具有投资价值的行业进行配置。

6. 资产配置比例：本基金将根据对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、海外市场等进行深入分析，从而对本基金的资产配置比例进行动态调整。本基金将通过大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，运用定性和定量的手段，定期或不定期地调整资产配置比例，以求在风险、收益、费率等大类资产之间的配置比例、调期策略和资产配置比例的优化。

7. 基金投资和预算准备金合计：110,990,129.49份 18.30

8. 其他资产：13,945,749.60份 2.30

9. 合计：600,501,402.71份 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、牧业 17,044,790.00 2.96

B 采矿业 -

C 制造业 272,518,907.12 47.26

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 69,020,966.02 12.15

E 建筑业 1,000,000.00 0.17

F 批发和零售业 9,651,560.15 1.68

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 30,906,474.03 5.37

J 金融业 2,056,268.16 0.46

K 房地产业 -

L 租赁和商务服务业 -

M 科学、技术服务业 14,258,603.06 2.45

N 国际贸易代理 26,208,417.90 4.38

O 居民服务、修理和其他服务业 -

P 教育 -

Q 卫生和社会工作 21,406,490.02 3.74

R 文化、体育和娱乐业 10,164,000.00 1.77

S 合计：7,769,000.00 1.35

4.1 报告期内基金的利润总额：401,507,523.63份 83.70

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 000002 长春高新 1,850,849 25,007,495.32 4.36

2 002325 丽珠集团 1,193,325 22,124,265.50 3.65

3 000700 河钢股份 4,090,927 21,644,764.01 3.66

4 000707 一汽解放 416,048 21,523,622.06 3.74

5 000444 云南白药 300,163 21,408,606.02 3.74

6 300146 南京聚力 370,600 17,647,972.00 3.07

7 002000 云投生态 656,100 17,044,790.00 2.96

8 600895 国电动力 2,000,000 16,700,000.00 2.90

9 002120 融捷股份 900,000 16,405,000.00 2.85

10 300082 天山铝业 250,000 15,180,000.00 2.64

5.4 报告期末按照行业分类的债券投资组合

注：本基金期末未持有债券。

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五名贵金属投资明细

注：本基金未持有贵金属。

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权证及权证投资明细

注：本基金未持有权证。

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股指期货投资明细

注：本基金未持有股指期货。

5.9 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国债期货投资明细

注：本基金未持有国债期货。

5.10 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资产支持证券投资明细

注：本基金未持有资产支持证券。

5.11 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黄金投资明细

注：本基金未持有黄金。

5.12 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股票期权投资明细

注：本基金未持有股票期权。

5.13 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期权投资明细

注：本基金未持有权证期权。

5.14 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。

5.15 报告期末持有的处于转股期的股票期权投资明细

注：本基金未持有股票期权。

5.16 报告期末持有的处于转股期的股指期权投资明细

注：本基金未持有股指期权。

5.17 报告期末持有的处于转股期的国债期货投资明细

注：本基金未持有国债期货。

5.18 报告期末持有的处于转股期的股票期权投资明细

注：本基金未持有股票期权。

5.19 报告期末持有的处于转股期的股指期权投资明细

注：本基金未持有股指期权。

5.20 报告期末持有的处于转股期的国债期货投资明细

注：本基金未持有国债期货。

5.21 报告期末持有的处于转股期的股票期权投资明细

注：本基金未持有股票期权。

5.22 报告期末持有的处于转股期的股指期权投资明细

注：本基金未持有股指期权。

5.23 报告期末持有的处于转股期的国债期货投资明细

注：本基金未持有国债期货。

5.24 报告期末持有的处于转股期的股票期权投资明细

注：本基金未持有股票期权。

5.25 报告期末持有的处于转股期的股指期权投资明细

注：本基金未持有股指期权。

5.26 报告期末持有的处于转股期的国债期货投资明细

注：本基金未持有国债期货。

5.27 报告期末持有的处于转股期的股票期权投资明细

注：本基金未持有股票期权。

5.28 报告期末持有的处于转股期的股指期权投资明细

注：本基金未持有股指期权。

5.29 报告期末持有的处于转股期的国债期货投资明细

注：本基金未持有国债期货。

5.30 报告期末持有的处于转股期的股票期权投资明细

注：本基金未持有股票期权。

5.31 报告期末持有的处于转股期的股指期权投资明细

注：本基金未持有股指期权。

5.32 报告期末持有的处于转股期的国债期货投资明细

注：本基金未持有国债期货。

5.33 报告期末持有的处于转股期的股票期权投资明细

注：本基金未持有股票期权。

5.34 报告期末持有的处于转股期的股指期权投资明细

注：本基金未持有股指期权。

5.35 报告期末持有的处于转股期的国债期货投资明细

注：本基金未持有国债期货。

5.36 报告期末持有的处于转股期的股票期权投资明细

注：本基金未持有股票期权。

5.37 报告期末持有的处于转股期的股指期权投资明细

注：本基金未持有股指期权。

5.38 报告期末持有的处于转股期的国债期货投资明细

注：本基金未持有国债期货。

5.39 报告期末持有的处于转股期的股票期权投资明细

注：本基金未持有股票期权。

5.40 报告期末持有的处于转股期的股指期权投资明细

注：本基金未持有股指期权。

5.41 报告期末持有的处于转股期的国债期货投资明细

注：本基金未持有国债期货。

5.42 报告期末持有的处于转股期的股票期权投资明细

注：本基金未持有股票期权。

5.43 报告期末持有的处于转股期的股指期权投资明细

注：本基金未持有股指期权。

5.44 报告期末持有的处于转股期的国债期货投资明细

注：本基金未持有国债期货。

5.45 报告期末持有的处于转股期的股票期权投资明细

注：本基金未持有股票期权。

5.46 报告期末持有的处于转股期的股指期权投资明细

注：本基金未持有股指期权。

5.47 报告期末持有的处于转股期的国债期货投资明细

注：本基金未持有国债期货。

5.48 报告期末持有的处于转股期的股票期权投资明细

注：本基金未持有股票期权。

5.49 报告期末持有的处于转股期的股指期权投资明细

注：本基金未持有股指期权。

5.50 报告期末持有的处于转股期的国债期货投资明细

注：本基金未持有国债期货。

5.51 报告期末持有的处于转股期的股票期权投资明细

注：本基金未持有股票期权。

5.52 报告期末持有的处于转股期的股指期权投资明细

注：本基金未持有股指期权。

5.53 报告期末持有的处于转股期的国债期货投资明细

注：本基金未持有国债期货。

5.54 报告期末持有的处于转股期的股票期权投资明细&lt;/