鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基金

【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:招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。

基金托管人招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	鹏华弘泽混合	
场内简称	-	
基金主代码	001172	
交易代码	001172	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年4月14日	
报告期末基金份额总额	2,460,075,963.12份	
投资目标	本基金在科学严谨的资产配置框架下,严选安全边际较高的股票,债券等投资标的,力争实现绝对收益的目标。	
投资策略	1.资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量(包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)以及各项国家政策(包括财政、税收、货币、汇率政策等),并结合类林时钟等科学严谨的资产配置模型,动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征,追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健的绝对收益目标。 2.股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司,严选其中安全边际较高的个股构建投资组合:自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会;自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等,并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判,严选安全边际较高的个股,力争实现组合的绝对收益。 3.债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略、中小企业私募债投资策略等系列投资策略,灵活地调整组合的券种搭配,精选安全边际较高的个券,力争实现组合的绝对收益。 4.股指期货、权证等投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本,达到稳定投资组合资产净值的目的。	
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)+3%	
风险收益特征	本基金属于混合型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金里中高风险、中高预期收益的品种。	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	鹏华弘泽混合A	鹏华弘泽混合C
下属分级基金的交易代码	001172	001381
报告期末下属分级基金的份额总额	1,223,467,925.40份	1,236,608,037.72份
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上	风险收益特征同上

§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)	
	鹏华弘泽混合A	鹏华弘泽混合C
1. 本期已实现收益	6,637,703.41	3,178,913.75
2. 本期利润	11,796,961.97	5,967,790.40
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0085	0.0084
4. 期末基金资产净值	1,268,445,976.13	1,262,221,809.06
5. 期末基金份额净值	1.037	1.021

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

鹏华弘泽混合A

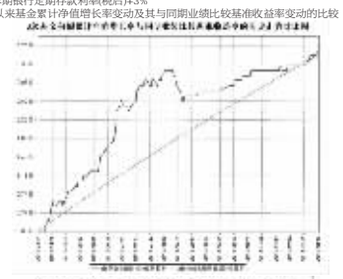
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.88%	0.04%	1.15%	0.01%	-0.27%	0.03%

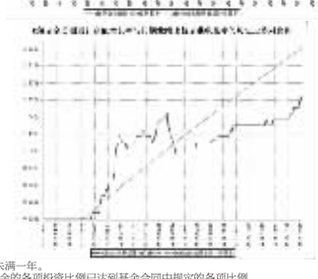
鹏华弘泽混合C

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	0.79%	0.04%	1.15%	0.01%	-0.36%	0.03%

注:业绩比较基准=一年期银行定期存款利率(税后)+3%

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





末本基金基金合同生效未满一年。

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		
袁航	本基金基金经理	2015年4月13日	-	6	袁航先生,国籍中国,经济学硕士,6年证券从业经验。2009年6月加盟鹏华基金管理有限公司,从事行业研究及投资助理相关工作,担任研究部医药研究员、投资经理助理。2014年11月起担任鹏华先进制造股票基金基金经理,2015年2月起兼任鹏华弘成混合基金基金经理,2015年4月起兼任鹏华弘泽混合基金基金经理,2015年5月起兼任鹏华弘远混合基金、鹏华弘信混合基金基金经理,2015年6月起兼任鹏华弘毅混合基金基金经理,2015年8月起兼任鹏华策略优选混合基金基金经理。袁航先生具备基金从业资格,本报告期内本基金基金经理未发生变动。
李君	本基金基金经理	2015年6月22日	-	6	李君女士,国籍中国,经济学硕士,6年金融证券从业经验,历任平安银行资金交易部银行账户管理岗、从事银行间市场资金交易工作;2010年8月加盟鹏华基金管理有限公司,担任集中交易室债券交易员,从事债券研究、交易工作;2013年1月至2014年6月担任鹏华货币基金基金经理,2014年2月至2015年5月担任鹏华增益宝货币基金基金经理,2015年5月起担任鹏华弘盛混合基金、鹏华弘利混合基金、鹏华弘泽混合基金、鹏华弘裕混合基金、鹏华弘腾混合基金基金经理,2015年11月起担任鹏华弘安混合基金基金经理,李君女士具备基金从业资格,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1.388元,累计净值1.448元;本报告期基金份额净值增长率为+17.03%,业绩比较基准收益率+15.66%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注: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	28,397,883.23	0.97
	其中:股票	28,397,883.23	0.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,004,232,251.20	34.29
	其中:债券	1,004,232,251.20	34.29
	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	853,201,419.80	29.14
	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	635,440,784.32	21.70
8	其他资产	407,090,431.90	13.90
9	合计	2,928,362,770.45	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	14,224,685.54	0.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,200,385.95	0.25
F	批发和零售业	222,304.44	0.01
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	2,288,575.86	0.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,123,538.00	0.20
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	338,393.44	0.01
S	综合	-	-
	合计	28,397,883.23	1.12

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	600138	中青旅	219,800	5,123,538.00	0.20
2	002013	中航机电	207,900	4,711,014.00	0.19
3	601668	中国建筑	730,100	4,628,834.00	0.18
4	000957	中通客车	180,026	4,398,035.18	0.17
5	600771	广誉远	64,300	2,119,971.00	0.08
6	000625	长安汽车	75,100	1,274,447.00	0.05
7	603508	思维列控	14,605	1,136,853.20	0.04
8	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.04
9	603866	桃李面包	23,133	893,165.13	0.04
10	002781	奇信股份	21,600	807,192.00	0.03

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	612,766,000.00	24.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	31,003,100.00	1.23
	其中:政策性金融债	31,003,100.00	1.23
4	企业债券	77,183,000.00	3.05
5	企业短期融资券	130,494,000.00	5.16
6	中期票据	40,400,000.00	1.60
7	可转债	2,661,151.20	0.10
8	同业存单	109,725,000.00	4.34
9	其他	-	-
10	合计	1,004,232,251.20	39.68

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	020078	15贴债04	3,900,000	383,604,000.00	15.16
2	111593155	15广州银行CD038	1,100,000	109,725,000.00	4.34
3	020080	15贴债06	1,000,000	98,410,000.00	3.89
4	019522	15国债22	500,000	50,515,000.00	2.00
5	041566009	15江铜CP001	500,000	50,375,000.00	1.99

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:本基金本报告期内未发生股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本,达到稳定投资组合资产净值的目的。

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中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	206,346.23
2	应收证券清算款	392,978,293.76
3	应收股利	-
4	应收利息	13,905,791.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	407,090,431.90

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 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600771	广誉远	2,119,971.00	0.08	重大事项停牌

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

项目	鹏华弘泽混合A	鹏华弘泽混合C
报告期期初基金份额总额	1,761,828,490.62	50,904,419.58
报告期期间基金总申购份额	2,572,718.40	1,185,956,311.73
减:报告期期间基金总赎回份额	540,933,283.62	252,693.59
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	1,223,467,925.40	1,236,608,037.72

§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

注:截止本报告期末,本基金管理人未持有本基金份额。

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)《鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基金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

深圳市深南大道7088号招商银行大厦招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

鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金

【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19日
报告期末基金份额总额	10,192,168.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。
业绩比较基准	沪深300指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金,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,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为交易型开放式指数基金,采用完全复制法跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。
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

§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	3,410,233.54
2.本期利润	5,455,053.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.5106
4.期末基金资产净值	38,168,082.55
5.期末基金份额净值	3.7448

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

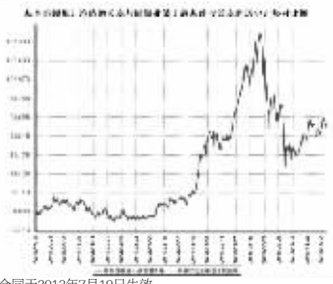
3.2 基金净值表现

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	15.58%	1.67%	16.49%	1.67%	-0.91%	0.00%

注:业绩比较基准=沪深300指数

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2013年7月19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		
崔俊杰	本基金基金经理	2013年7月19日	-	7	崔俊杰先生,国籍中国,金融工程专业管理学硕士,7年证券从业经验。2008年7月加盟鹏华基金管理有限公司,历任产品规划部产品设计师、量化投资部量化研究员,先后从事产品设计、量化研究工作,2013年3月起担任鹏华深证民营板ETF基金及其联接基金基金经理,2013年3月起兼任鹏华上证民企50ETF基金及其联接基金基金经理,2013年7月起兼任鹏华沪深300ETF基金基金经理,2014年12月起兼任鹏华资源分级基金基金经理,2014年12月起兼任鹏华传媒分级基金基金经理,2015年8月起兼任鹏华医药分级基金基金经理,崔俊杰先生具备基金从业资格,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4季度,整个A股市场呈现震荡向上波澜不惊的局面,在11月初金融股的拉升之后趋于平稳。本基金秉承指数基金的投资策略,在应对申购赎回的基础上,力争跟踪指数收益,并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

2015年4季度市场波动仍然较高,对基金的管理运作带来一定影响,面临这种情况,我们进行了精心的管理,较好的实现了跟踪误差控制目标。

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3.7448元,累计净值1.6572元;本报告期基金份额净值增长率为15.58%。本报告期基金日均跟踪偏离度的绝对值0.013%,年化跟踪误差0.319%。

对本基金而言,报告期内跟踪误差的主要来源为:样本股特殊事件导致的停复牌、成分股调整以及为应对申购赎回必要的现金留存等,对此我们采取了进一步的优化策略进行应对。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形;截至报告期末,本基金资产净值仍低于五千万元。

§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	38,039,706.19	98.43
	其中:股票	38,039,706.19	98.43
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	606,744.51	1.57
8	其他资产	1,335.82	0.00
9	合计	38,647,786.52	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2.1的合计项不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	34,171.20	0.09
B	采矿业	1,302,657.51	3.41
C	制造业	12,276,370.57	32.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,569,967.42	4.11
E	建筑业	1,466,548.15	3.84
F	批发和零售业	860,236.46	2.25
G	交通运输、仓储和邮政业	1,383,376.61	3.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,309,669.26	6.05
J	金融业	13,141,264.60	34.43
K	房地产业	2,013,433.16	5.28
L	租赁和商务服务业	391,153.95	1.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	329,900.20	0.86
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	45,791.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	697,156.30	1.83
S	综合	218,009.80	0.57
	合计	38,039,706.19	99.66

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	601318	中国平安	42,082	1,514,952.00	3.97
2	600016	民生银行	114,860	1,107,250.40	2.90
3	601166	兴业银行	51,820	884,567.40	2.32
4	000002	万 科A	30,140	736,320.20	1.93
5	600036	招商银行	40,099	721,381.01	1.89
6	600000	浦发银行	36,260	662,470.20	1.74
7	600030	中信证券	30,580	591,723.00	1.55
8	601328	交通银行	91,540	589,517.60	1.54
9	600837	海通证券	31,489	498,155.98	1.31
10	601288	农业银行	148,640	480,107.20	1.26

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

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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海通证券股份有限公司(以下简称"本公司"或"公司")于2015年11月26日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《调查通知书》(稽查总队调查通字153122号)。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。

本公司将全面配合中国证监会的调查工作,同时严格按照监管要求履行信息披露义务,目前公司的经营情况正常。

《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和上海证券交易所网站(http://www.sse.com.cn)为公司指定信息披露媒体及网站,公司发布的信息均以上述媒体及网站刊登或发布的公告为准,敬请广大投资者理性投资、注意投资风险。

海通证券股份有限公司(以下简称"本公司"或"公司")于2015年8月24日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《调查通知书》(津证调查字【2015011】号)。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,中国证监会决定对公司进行立案调查。

在调查期间,本公司将全面配合中国证监会的调查工作,同时严格按照监管要求履行信息披露义务,目前公司的经营情况正常。

《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和上海证券交易所网站(http://www.sse.com.cn)为公司指定信息披露媒体,公司发布的信息均以上述媒体刊登或发布的公告为准,敬请广大投资者理性投资、注意投资风险。

对该股票的投资决策程序的说明:本基金为指数基金,为更好地跟踪标的指数,控制跟踪误差对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置,符合指数基金的管理规定,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。

组合投资的前十名证券之一的中信证券的发行主体中信证券股份有限公司在2015年11月26日,中信证券股份有限公司(以下简称"公司"或"本公司")收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")调查通知书(稽查总队调查通字153121号),其中提及:因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定,中国证监会决定对公司进行立案调查。

公司将全面配合中国证监会的相关调查工作,同时严格按照有关规定履行信息披露义务。

目前,公司经营情况正常。本公司发布的信息以公司公告为准,请广大投资者理性投资,注意风险。

对该股票的投资决策程序的说明:本基金为指数基金,为更好地跟踪标的指数,控制跟踪误差对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置,符合指数基金的管理规定,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	89,269.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,209.16
5	应收申购款	5,102,481.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,194,959.67

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 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万 科A	5,000,283.68	1.75	重大事项

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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	10,192,168.00
报告期期间基金总申购份额	6,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	6,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	10,192,168.00

§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

注:截止本报告期末,本基金管理人未持有本基金份额。

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)《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金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

北京市西城区金融大街25 号中国建设银行股份有限公司

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