鹏华动力增长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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	鹏华动力增长混合(LOF)
场内简称	鹏华动力
交易代码	160610
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2007年1月9日
报告期末基金份额总额	1,699,232,345.61份
投资目标	精选具有高成长性和持续盈利潜长潜力的上市公司中价值相对低估的股票,进行积极主动的投资管理,在有效控制投资风险的前提下,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:本基金股票投资采取"自上而下"和"自下而上"相结合的主动投资管理策略,策略分为战略性资产配置、动态资产配置和个股选择等三个层次,重点投资具备高成长性和持续盈利潜长潜力的上市公司中价值相对低估的股票。 (2)债券投资:本基金债券投资的主要目的是规避股票投资部分的系统性风险,在投资过程中综合运用久期、收益率曲线、流动性、相对价值挖掘、套利等策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金属于混合型(偏股型)基金,其预期风险和收益高于货币型基金、债券基金、混合型基金中的偏债型基金,低于股票型基金,为证券投资基金中的中等风险品种。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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	112,100,678.87
2.本期利润	418,545,402.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.2360
4.期末基金资产净值	2,531,197,282.94
5.期末基金份额净值	1.490

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。

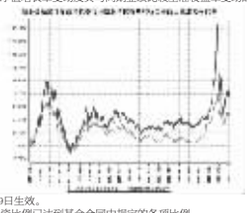
3.2 基金净值表现

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	18.35%	1.71%	12.28%	1.17%	6.07%	0.54%

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%。

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1月9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		
梁浩	本基金基金经理	2015年7月29日	-	7	梁浩先生,国籍中国,经济学博士,7年证券从业经验。曾任职于信息产业部电信研究院,从事产业政策研究工作;2008年5月加盟鹏华基金管理有限公司,从事研究分析工作,担任研究部高级研究员、基金经理助理,2014年3月至2015年12月兼任鹏华环保产业股票基金基金经理,2014年11月至2015年12月兼任鹏华先进制造股票基金基金经理2011年7月起担任鹏华新兴产业混合基金基金经理,2015年7月起兼任鹏华动力增长混合(LOF)基金基金经理,现同时担任研究部总经理、投资决策委员会成员。梁浩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,在基金合同的约定,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

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,跟踪指数收益,力争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0.7860元,累计净值0.7990元。本报告期基金份额净值增长率为10.77%。

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	1,010,769,034.54	91.44
	其中:股票	1,010,769,034.54	91.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	537,000.00	0.05
	其中:债券	537,000.00	0.05
	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	93,319,937.22	8.44
8	其他资产	815,111.36	0.07
9	合计	1,105,441,083.12	100.00

5.1.1 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	27,106,681.00	1.07
B	采矿业	-	-
C	制造业	993,781,778.68	39.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	34,040,442.52	1.34
F	批发和零售业	-	-
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	67,618,026.28	2.67
J	金融业	-	-
K	房地产业	160,187,784.85	6.33
L	租赁和商务服务业	168,367,513.78	6.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	46,701,665.23	1.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	213,241,233.84	8.42
R	文化、体育和娱乐业	211,331,752.78	8.35
S	综合	-	-
	合计	1,922,376,878.96	75.95

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	300244	迪安诊断	2,357,896	163,968,087.84	6.48
2	002152	广电运通	4,247,607	131,633,340.93	5.20
3	000802	北京文化	3,521,436	119,306,251.68	4.71
4	002450	康得新	2,873,167	109,467,662.70	4.32
5	002400	省广股份	4,000,000	100,600,000.00	3.97
6	002343	禾欣股份	1,499,881	91,042,776.70	3.60
7	600201	生物股份	2,308,504	85,345,392.88	3.37
8	600872	中炬高新	4,999,870	78,247,965.50	3.09
9	002250	联化科技	4,129,133	77,916,739.71	3.08
10	000709	河北钢铁	22,866,600	76,145,778.00	3.01

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

组合投资的前十名证券之一的北京文化的发行主体北京京西文化旅游股份有限公司在2015年3月10日收到深圳证券交易所向公司出具的《关于对北京京西文化旅游股份有限公司的关注函》(公司部关注函【2015】第95号),对公司在互动易平台上发布的信息与年报披露存在前后矛盾一事表示关注。2015年4月22日,深圳证券交易所向公司出具了《关于对北京京西文化旅游股份有限公司的关注函》(公司部关注函【2015】第172号),对公司已超过十天未在互动易平台上回答投资者的提问一事表示关注。2014年4月28日,深圳证券交易所向公司出具了《关于对北京京西风光旅游开发股份有限公司的年报问询函》(公司部年报问询函【2014】第140号),就公司2013年年报相关问题要求公司予以书面说明。2015年4月28日,深圳证券交易所向公司出具了《关于对北京京西文化旅游股份有限公司的年报问询函》(公司部年报问询函【2015】第99号),就公司2014年年报相关问题要求公司予以书面说明,并进行补充披露。

根据公司公告,最近五年,公司未被证券监管部门采取监管措施,公司被交易所出具监管函2次,关注函6次,年报问询函5次。公司已按照相关要求进行答复并作出相应整改。本基金管理人长期跟踪研究该股票,该证券的投资已严格执行内部投资决策流程,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	1,978,798.24
2	应收证券清算款	66,076,791.42
3	应收股利	-
4	应收利息	130,768.17
5	应收申购款	137,200.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	68,323,558.45

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	1,832,915,682.27
报告期期间基金总申购份额	26,725,297.33
减:报告期期间基金总赎回份额	160,408,633.99
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	1,699,232,345.61

§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未申购、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)《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》;

(二)《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)托管协议》;

(三)《鹏华动力增长混合型证券投资基金(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第43层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9中国农业银行股份有限公司

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

鹏华纯债债券型证券投资基金

【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的法律责任。

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	鹏华纯债债券
场内简称	-
基金主代码	206015
交易代码	206015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月3日
报告期末基金份额总额	473,160,771.41份
投资目标	在适度控制风险的基础上,通过严格的利差分析和对利率曲线变动趋势的判断,提高资金流动性和收益率水平,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金债券投资将主要采取久期策略,同时辅之以信用利差策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略,在适度控制风险的基础上,通过严格的利差分析和对利率曲线变动趋势的判断,提高资金流动性和收益率水平,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。 在资产配置方面,本基金通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率曲线变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析,比较未来一定时间内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率,在基金规定的投资比例范围内对不同久期、信用特征的券种及债券与现金之间进行动态调整。
业绩比较基准	中债总指数收益率
风险收益特征	本基金属于债券型基金,其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,为证券投资基金中具有较低风险收益特征的品种。
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	3,769,367.08
2.本期利润	16,011,255.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.0336
4.期末基金资产净值	506,866,643.15
5.期末基金份额净值	1.071

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。

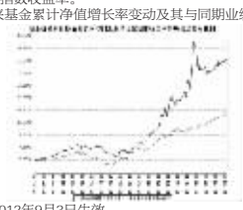
3.2 基金净值表现

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	3.13%	0.17%	3.10%	0.11%	0.03%	0.06%

注:业绩比较基准=中债总指数收益率。

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2012年9月3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		
刘太阳	本基金基金经理	2012年9月3日	-	9	刘太阳先生,国籍中国,理学硕士,9年金融证券从业经验。曾任中国农业银行金融市场部高级交易员,从事债券投资交易工作;2011年5月加盟鹏华基金管理有限公司,从事债券研究工作,担任固定收益部研究员。2012年9月起担任鹏华纯债债券基金基金经理,2012年12月至2014年3月担任鹏华理财21天债券基金(2014年3月已转型为鹏华月月发短期理财债券基金)基金经理,2013年4月起兼任鹏华丰利分级债券基金基金经理,2013年5月起兼任鹏华实业债纯债债券基金基金经理,2014年3月起兼任鹏华月月发短期理财债券基金基金经理,2015年3月起兼任鹏华丰盛债券基金基金经理,现同时担任固定收益部副总经理。刘太阳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年第四季度,债券市场整体上涨。期间虽受新股发行冲击影响,资金面略有紧张,债券收益率出现小幅上行;但随后在经济增速持续下滑及资金面继续宽松影响,机构加大债券配置力度,推动债券收益率曲线出现平坦化下行,7年期以上品种收益率回落幅度超过40BP。第四季度所有全价及财富指数均出现不同程度的上涨,其中金融债财富指数上涨幅度最大,涨幅达3.22%。

在第四季度,基于经济增长较弱及政策放松的判断,我们对整体债券市场持谨慎乐观态度,组合久期维持中性水平,主要配置3年期附近中期品种,其中信用品种以中高评级为主。此外,在第四季度,我们适当加大了可转债的配置力度。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本季度基金份额净值增长率为3.13%,业绩基准增长率为3.1%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	584,678,865.00	85.50
	其中:债券	584,678,865.00	85.50
	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	89,314,925.86	13.06
8	其他资产	9,820,820.48	1.44
9	合计	683,814,611.34	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

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前十名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,030,000.00	3.95
	其中:政策性金融债	20,030,000.00	3.95
4	企业债券	233,784,498.80	46.12
5	企业短期融资券	256,577,000.00	50.62
6	中期票据	-	-
7	可转债	74,287,366.20	14.66
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	584,678,865.00	115.35

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	132001	14宝钢EB	452,230	69,987,114.80	13.81
2	124294	13苏华靖	499,500	51,868,080.00	10.23
3	041559021	15京机电CP001	500,000	50,380,000.00	9.94
4	041558065	15津铁投CP001	500,000	50,290,000.00	9.92
5	112296	15东北债	400,000	40,116,000.00	7.91

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	18,512.70
2	应收证券清算款	1,578,116.76
3	应收股利	-
4	应收利息	7,839,280.45
5	应收申购款	384,910.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,820,820.48

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110030	格力转债	702,318.20	0.14
2	132001	14宝钢EB	69,987,114.80	13.81

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 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	475,104,055.98
报告期期间基金总申购份额	37,940,133.47
减:报告期期间基金总赎回份额	39,883,418.04
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	473,160,771.41

§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未申购、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)《鹏华纯债债券型证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华纯债债券型证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华纯债债券型证券投资基金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第43层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区阜市口大街1号院1号楼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

鹏华创业板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	鹏华创业板分级		
场内简称	创业指基		
基金主代码	160637		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年6月9日		
报告期末基金份额总额	1,394,881,337.21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,力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。		
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法,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或成份股发生配股、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。 本基金力争鹏华创业板份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。		
业绩比较基准	创业板指数收益率×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,其预期的风险与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。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司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		
下属分级基金简称	创业板分级	创业板A	创业板B
下属分级场内简称	创业指基	创业A	创业B
下属分级基金交易代码	160637	150243	150244
下属分级基金报告期末基金份额总额	158,624,418.21份	618,128,459.00份	618,128,460.00份
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与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。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。	鹏华创业板A份额为稳健收益类份额,具有低风险且预期收益相对较低的特征。	鹏华创业板B份额为积极收益类份额,具有高风险且预期收益相对较高的特征。

§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	7,082,480.49
2.本期利润	6,875,530.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0086
4.期末基金资产净值	1,096,001,992.12
5.期末基金份额净值	0.786

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	10.77%	2.14%	28.73%	2.43%	-17.96%	-0.29%

注:业绩比较基准=创业板指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%

3.2.2 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:1、本基金基金合同于2015年6月9日生效,截至本报告期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		
王咏辉	本基金基金经理	2015年6月9日	-	17	王咏辉先生,国籍英国,工程和计算机专业硕士,17年证券基金从业经验。曾担任伦敦摩根大通(JPMorgan)投资基金管理公司高级分析师,汇丰投资基金管理公司(HSBC)高级分析师,伦敦巴克莱国际投资基金管理公司基金经理、部门负责人,巴克莱资本公司(BarclaysCapital)部门负责人,泰达宏利基金公司国际投资部副总监、产品与金融工程部副总经理及泰达宏利中证财富大盘指数基金、泰达宏利全球新格局QDII基金、泰达中证500基金基金经理等职;2012年11月加盟鹏华基金管理有限公司,2013年12月起担任鹏华中证500指数(LOF)基金基金经理,2014年9月起兼任鹏华地产分级基金基金经理,2014年12月起兼任鹏华沪深300指数(LOF)基金基金经理,2015年6月起兼任鹏华创业板分级基金、鹏华互联网分级基金基金经理,现同时担任量化及衍生品投资部总经理、投资决策委员会成员。王咏辉先生具备基金从业资格,英国基金经理从业资格(IMC)。本报告期内本基金基金经理发生变动,增聘焦文龙担任本基金基金经理。
焦文龙	本基金基金经理	2015年11月19日	-	6	焦文龙先生,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,历任监察稽核部金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员,先后从事金融工程、量化研究等工作;2015年5月起担任鹏华一带一路分级基金基金经理,2015年5月起兼任鹏华高铁产业分级基金、鹏华新能源分级基金基金经理,2015年8月起兼任鹏华新丝路分级基金、鹏华钢铁分级基金基金经理,2015年11月起兼任鹏华创业板分级基金基金经理。焦文龙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,增聘焦文龙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