# 鹏华中证医药卫生指数证券投资基金(LOF) 2016年年度报告摘要

2016年 12 月 31 日

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

送出日期:2017 年 3 月 30 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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 2017 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师对本基金出具了"标准无保留意见"的审计报告。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 鹏华中证医药卫生 |
| 场内简称 | 医药基金 |
| 基金主代码 | 160635 |
| 前端交易代码 | - |
| 后端交易代码 | - |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式(LOF) |
| 基金合同生效日 | 2015年 8 月 17 日 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 32,714,245.50 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2016年 8 月 1 日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 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,按照成份股和权重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权重的变化进行相应调整。<br>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,或预基金的申购和赎回导致本基金跟踪标的指数的效果可能产生影响时,或因其他特殊因素导致被动式指不足时,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。<br>本基金力争跟踪标的指数与其指数编制目标基本一致,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。<br>1.投资组合策略<br>(1)股票投资组合的构建<br>本基金主要投资于标的指数成分股及备选股票的品种,投资比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。本基金可以投资于预期成份股发生调整和成份股因配股、增发、分红等行为时,或因其他因素导致无法有效复制和跟踪标的指数时,或因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。<br>本基金力争跟踪标的指数与其指数编制目标基本一致,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原因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。<br>(2)股票投资组合的调整<br>本基金所构造的股票投资组合的权数标的指数成份股及其权重的变动完全进行相应调整。本基金还将根据法律允许的投资比例限制,由于期货交易成本,交易费用等因素,以有效管理和降低本产品的跟踪误差和跟踪偏离度为目的,在不影响投资组合的流动性的前提下,适当地对投资组合进行调整,以有效管理和降低本产品的跟踪误差和跟踪偏离度为目的,在不影响投资组合的流动性的前提下,适当地对投资组合进行调整,加强流动性交易的不股票可能采用合理方法进行处理,由于受到各项限制比例限制,基金可能不能按照成份股权重对应成份股,基金将会采用合理方法进行处理。<br>1)定期调整<br>根据标的指数的调整规则和基金股票的原则,对股票投资组合进行定期调整。<br>2)不定期调整<br>根据指数编制规则,当标的指数成份股调整,送配等股权变动将要进行成份股权重调整时,本基金将根据基金合同的规定变化进行相应调整。<br>根据基金合同和指数跟踪规则,结果导致投资组合进行调整,从而有效跟踪指数。<br>根据法律,法规规定,成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化时,本基金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。<br>2.股票投资策略<br>本基金可以根据成功投资管理要求,选取到期日在一年以内的政府债券进行配置,本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析,货币政策分析,利率预测来未来利率变化,并利用债券定价技术,进行个券选择。<br>3.股指期货策略<br>本基金可以投资股指期货,规避系统性中国证监会允许的金融衍生产品。<br>本基金投资股指期货策略是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。<br>4.资产支持证券投资策略<br>本基金投资资产支持证券的目的是在控制风险的前提下,提高组合的收益率,本基金将以投资组合久期与标的指数久期偏离最小为原则,结合对证券的信用风险、提前偿付风险、流动性风险、利率风险等风险的控制,基金管理人将以对投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析;《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。 | |
| 业绩比较基准 | 中证医药卫生指数收益率 *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,为较预期基金中较高风险,较高预期收益品种,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。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 鹏华基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 张戈 | 田青 |
| | 联系电话 | 0755-82825720 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | zhangge@phfund.com.cn | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 4006789999 | 010-67595096 |
| 传真 | | 0755-82021126 | 010-66275853 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.phfund.com |
| 基金年度报告备置地点 | 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 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期末数据和指标 | 2016年 | 2015年 8 月 17 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 | 2014年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | - 2,756,045.29 | 880,188.75 | - |
| 本期利润 | - 4,228,355.88 | 1,976,408.33 | - |
| 加权平均基金份额本期利润 | - 0.1067 | 0.0390 | - |
| 本期基金份额净值增长率 | - 16.51% | 5.86% | - |
| 3.1.2 期末期末数据和指标 | 2016年末 | 2015年末 | 2014年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | - 0.1283 | 0.0249 | - |
| 期末基金资产净值 | 31,894,308.17 | 38,308,474.27 | - |
| 期末基金份额净值 | 0.975 | 1.051 | - |

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。

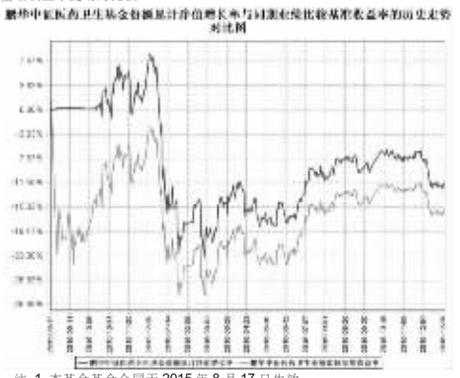
(3)表中的"期末"均指报告期最后一日,即 12 月 31 日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

(4)本基金基金合同于 2015 年 8 月 17 日生效,至 2015 年 12 月 31 日未满一年,故 2015 年的数据和指标为非完整会计年度数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 | - 3.27% | 0.67% | - 2.48% | 0.65% | - 0.79% | 0.02% |
| 过去六个月 | 2.87% | 0.75% | 4.55% | 0.73% | - 1.68% | 0.02% |
| 过去一年 | - 16.51% | 1.58% | - 11.39% | 1.57% | - 5.12% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | - 11.62% | 1.48% | - 15.85% | 1.87% | 4.23% | - 0.39% |

注:业绩比较基准 = 中证医药卫生指数收益率 *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