鹏华产业债债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30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
报告送出日期:2017年10月25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2017年10月20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2017年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华产业债债券
场内简称	-
基金主代码	206018
交易代码	206018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年2月6日
报告期末基金份额总额	90,252,497.61份
投资目标	在追求基金资产稳定增值、有效控制风险的基础上,通过对产业债积极主动的投资管理,力求取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	1.资产配置策略 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类资产与现金类资产之间进行动态调整。 2.债券投资策略 本基金在债券投资中以产业债投资为主,一般情况下,在债券类投资产品中,产业债的收益率要高于国债、央行票据等其他债券的收益率。投资产业债是通过主动承担适度的信用风险来获取较高的收益,所以在个券的选择当中特别重视信用风险的评估和防范。 本基金将主要采取信用策略,同时辅之以久期策略、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,通过严格的信用分析和对信用利差变动趋势的判断,力争获取信用溢价,以最大程度上取得超越基金业绩比较基准的收益。
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中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(2017年7月1日－2017年9月30日)
1.本期已实现收益	1,538,885.73
2.本期利润	2,593,613.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0192
4.期末基金资产净值	98,024,305.31
5.期末基金份额净值	1.086

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	1.21%	0.13%	0.33%	0.06%	0.88%	0.07%

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2013年2月6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。
3.3 其他指标
无。

§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		
祝松	本基金基金经理	2014年3月14日	-	11	祝松先生,国籍中国,经济学硕士,11年金融证券从业经验。曾任职于中国工商银行深圳市分行资金营运部,从事债券投资及理财产品组合投资管理;招商银行总行金融市场部,担任代客理财投资经理,从事人民币理财产品组合的投资管理工作。2014年1月加盟鹏华基金管理有限公司,从事债券投资管理工作,2014年2月起担任晋天债券基金基金经理,2014年2月起兼任鹏华丰润债券(LOF)基金基金经理,2014年3月起兼任鹏华产业债债券基金基金经理,2015年3月起兼任鹏华双债加利债券基金基金经理,2015年12月起兼任鹏华丰华债券基金基金经理,2016年2月起兼任鹏华弘泰混合基金基金经理,2016年6月起兼任鹏华金城保本混合基金、鹏华丰茂债券基金基金经理,2016年12月起兼任鹏华永盛定期开放债券、鹏华丰惠债券、鹏华丰益债券基金经理,2017年3月起兼任鹏华永安定期开放债券基金基金经理,2017年5月起兼任鹏华永泰定期开放债券基金基金经理,现同时担任固定收益部副总经理。祝松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。本报告期内未发生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%的情况。
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2017年三季度我国债券市场利率整体小幅上行,与上季度末相比,上证国债指数上涨0.17%,银行间中债综合财富指数上涨0.80%。七、八月份市场资金面整体趋紧,债券利率持续上行;九月份之后伴随同业存单发行利率下行和经济数据的回落,市场情绪有所改善,债券利率小幅回落。
权益及可转债市场方面,三季度股票市场整体上涨,但板块间分化迹象依然明显,本季度上证综指上涨4.90%;受股票市场上涨影响,三季度转债及可交换债涨多跌少,部分权重品种涨幅较大,本季度中证转债指数上涨4.26%。
报告期内本基金以持有中高评级信用债为主,同时进行了利率债波段操作,债券组合久期整体保持中性水平。此外,本基金对可转债和可交换债进行了一定规模配置。
4.5 报告期内基金的业绩表现
2017年三季度本基金份额净值增长率为1.21%,同期业绩基准增长率为0.33%。
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	123,680,328.30	95.51
	其中:债券	123,680,328.30	95.51
	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	3,120,405.02	2.41
8	其他资产	2,694,554.53	2.08
9	合计	129,495,287.85	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
无。
5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
无。
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
无。
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	2,397,400.00	2.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,061,000.00	10.26
	其中:政策性金融债	10,061,000.00	10.26
4	企业债券	95,650,466.00	97.58
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	15,571,462.30	15.89
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	123,680,328.30	126.17

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。本报告期内未发生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%的情况。
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2017年三季度我国债券市场利率整体小幅上行,与上季度末相比,上证国债指数上涨0.17%,银行间中债综合财富指数上涨0.80%。七、八月份市场资金面整体趋紧,债券利率持续上行;九月份之后伴随同业存单发行利率下行和经济数据的回落,市场情绪有所改善,债券利率小幅回落。
权益及可转债市场方面,三季度股票市场整体上涨,但板块间分化迹象依然明显,本季度上证综指上涨4.90%;受股票市场上涨影响,三季度转债及可交换债涨多跌少,部分权重品种涨幅较大,本季度中证转债指数上涨4.26%。
报告期内本基金以持有中高评级信用债为主,同时进行了利率债波段操作,债券组合久期整体保持中性水平。此外,本基金对可转债和可交换债进行了一定规模配置。
4.5 报告期内基金的业绩表现
2017年三季度本基金份额净值增长率为1.21%,同期业绩基准增长率为0.33%。
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	123,680,328.30	95.51
	其中:债券	123,680,328.30	95.51
	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	3,120,405.02	2.41
8	其他资产	2,694,554.53	2.08
9	合计	129,495,287.85	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
无。
5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
无。
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
无。
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	2,397,400.00	2.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,061,000.00	10.26
	其中:政策性金融债	10,061,000.00	10.26
4	企业债券	95,650,466.00	97.58
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	15,571,462.30	15.89
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	123,680,328.30	126.17

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	170415	17农发15	100,000	10,061,000.00	10.26
2	122376	15首置01	100,000	9,857,000.00	10.06
3	122028	09华发债	98,000	9,809,800.00	10.01
4	122928	09铁岭债	97,000	9,791,180.00	9.99
5	127409	16渝地产	100,000	9,563,000.00	9.76

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
无。
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
无。
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
无。
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
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
对该证券的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该证券发行人,认为华泰证券作为中国证监会BBB级综合类证券公司,行业地位较为突出,经营较为稳定,上述行政措施中涉及的问题不会对华泰证券的财务状况及经营成果产生实质重大影响。上述行政监管措施对该证券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。
5.10.2
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	9,887.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,683,517.50
5	应收申购款	1,149.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,694,554.53

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	132001	14宝钢EB	5,726,388.00	5.84
2	113011	光大转债	4,935,906.00	5.04
3	110032	三一转债	1,463,944.00	1.49
4	120001	16以岭EB	1,128,217.00	1.15
5	110033	国贸转债	980,080.00	1.00
6	132006	16皖新EB	790,608.00	0.81
7	132003	15清控EB	56,320.00	0.06

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。
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	198,447,802.95
报告期期间基金总申购份额	1,190,548.81
减:报告期期间基金总赎回份额	109,385,854.15
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	90,252,497.61

§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
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
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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170701~20170828	53,955,935.25	-	53,955,935.25	-	0.00%
	2	20170701~20170711	46,501,607.24	-	46,501,607.24	-	0.00%
	3	20170701~20170930	48,656,302.81	225,888.12	-	48,882,190.93	54.16%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时,可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动,甚至可能引发基金流动性风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注:1.申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、场内买入份额、指数分级基金合并份额和红利再投;
2.赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、场内卖出份额和指数分级基金拆分份额。
8.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
(一)《鹏华产业债债券型证券投资基金基金合同》;
(二)《鹏华产业债债券型证券投资基金托管协议》;
(三)《鹏华产业债债券型证券投资基金2017年第3季度报告》(原文)。
9.2 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
9.3 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
2017年10月25日

鹏华创业板指数分级证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30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
报告送出日期:2017年10月25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2017年10月20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2017年7月1日起至9月30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
交易代码	160637
前端交易代码	-
后端交易代码	-
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	643,774,875.84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
下属分级基金的基金简称	创业板分级	创业板A	创业板B
下属分级基金场内简称	创业指基	创业A	创业B
下属分级基金的交易代码	160637	150243	150244
报告期末下属分级基金的份额总额	96,247,939.84份	273,763,468.00份	273,763,468.00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(2017年7月1日－2017年9月30日)
1.本期已实现收益	-20,858,494.17
2.本期利润	7,469,521.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0112
4.期末基金资产净值	556,687,434.30
5.期末基金份额净值	0.865

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	1.53%	1.09%	2.58%	1.08%	-1.05%	0.01%

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: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%
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。
3.3 其他指标
注:无。

§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		
陈龙	本基金基金经理	2016年7月15日	-	8	陈龙先生,国籍中国,经济学硕士,8年证券从业经验。曾任杭州衡泰软件公司金融工程师,2009年12月加盟鹏华基金管理有限公司,历任监察稽核部金融工程总监助理、量化及衍生品投资部量化研究总监助理,先后从事金融工程、量化研究等工作;2015年9月起担任鹏华钢铁分级基金基金经理,2016年7月起兼任鹏华创业板分级基金基金经理,2016年9月起兼任鹏华地产分级、鹏华香港中小企业指数(LOF)基金经理,2016年10月起兼任鹏华互联网分级基金基金经理。陈龙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。本报告期内未发生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%的情况。
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2017年3季度,A股继续震荡上行,报告期内上证指数上涨4.90%,沪深300指数大幅上涨4.63%,创业板指数上涨2.69%,周期板块大幅上涨,其余各板块也均有所表现。
本基金秉承指数基金的投资策略,力争跟踪指数的收益,并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0.865元,累计净值0.562元;本报告期基金份额净值增长率为1.53%,同期业绩比较基准收益率为2.58%。
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	526,520,566.01	93.94
	其中:股票	526,520,566.01	93.94
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	32,408,050.83	5.78
8	其他资产	1,545,027.49	0.28
9	合计	560,473,644.33	100.00

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境内股票投资组合

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	36,525,958.92	6.56
B	采矿业	-	-
C	制造业	254,839,763.74	45.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,715,408.44	1.92
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	143,533,415.44	25.78
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	12,776.05	0.00
S	综合	-	-
	合计	7,297,792.87	1.31

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
注:无。
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
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	300498	温氏股份	1,698,092	36,525,958.92	6.56
2	300059	东方财富	1,329,684	18,389,529.72	3.30
3	300104	乐视网	1,480,580	16,508,467.00	2.97
4	300136	信维通信	346,020	14,532,840.00	2.61
5	300124	汇川技术	469,940	13,581,266.00	2.44
6	300070	碧水源	680,825	12,261,658.25	2.20
7	300072	三聚环保	397,486	12,115,373.28	2.18
8	300408	三环集团	485,080	11,928,117.20	2.14
9	300024	机器人	554,825	11,828,869.00	2.12
10	300003	乐普医疗	409,255	8,794,889.95	1.58

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	300267	尔康制药	401,549	4,601,751.54	0.83
2	300376	易事特	267,100	2,321,099.00	0.42
3	002900	哈三联	1,983	83,087.70	0.01
4	300702	天宇股份	1,124	68,968.64	0.01
5	002901	大博医疗	1,834	49,206.22	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:无。
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:无。
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:无。
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:无。
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:无。
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
注: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
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
5.10.2 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
注: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	100,908.43
2	应收证券清算款	1,073,228.55
3	应收股利	-
4	应收利息	6,350.88
5	应收申购款	364,539.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,545,027.49

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:无。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
5.11.6 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	300104	乐视网	16,508,467.00	2.97	重大事项

5.11.7 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

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	300267	尔康制药	4,601,751.54	0.83	重大事项
2	300376	易事特	2,321,099.00	0.42	重大事项

5.11.8 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	创业板分级	创业板A	创业板B
报告期期初基金份额总额	99,854,802.16	302,739,919.00	302,739,919.00
报告期期间基金总申购份额	64,158,186.32	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	125,717,950.64	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	57,952,902.00	-28,976,451.00	-28,976,451.00
报告期期末基金份额总额	96,247,939.84	273,763,468.00	273,763,468.00

§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未申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	20170701~20170930	169,177,763.00	62,116,379.00	80,941,380.00	150,352,762.00	23.35%
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时,可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动,甚至可能引发基金流动性风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注:1.申