鹏华新丝路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:招商银行股份有限公司
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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年9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	鹏华新丝路指数分级
场内简称	新丝路
基金主代码	502026
交易代码	502026
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金合同生效日	2015年6月19日
报告期末基金份额总额	12,940,882.57份
投资目标	紧密跟踪新丝路指数,追求跟踪偏离和跟踪误差最小化,力争日均跟踪偏离度绝对值不超过0.35%,年跟踪误差标准差不超过4%。
投资策略	在基金合同约定的投资范围内,根据证券投资市场的变动情况,适时调整投资组合,以期在规避风险的前提下,实现基金资产的保值增值。 当指数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导致本基金跟踪标的指数的股票权数平均偏离度超过规定比例时,则应采取相应的调整措施,以期将组合投资偏离度控制在规定范围内。 本基金为鹏华普通股票型证券投资基金的子基金,本基金投资组合中,权益类资产的比例为80%-95%,其中,投资于本基金所属基金类别的股票资产的比例不低于基金资产净值的80%,其中,投资于本基金所属基金类别的股票资产的比例不低于非现金基金资产的80%,本基金投资于股票资产的比例为基金资产扣除现金后的净额的80%-95%,其中,投资于本基金所属基金类别的