鹏华中证800证券保险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	鹏华证券保险分级
场内简称	证保分级
交易代码	160625
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	2014年5月5日
报告期末基金份额总额	1,006,879,506.25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。 本基金力争鹏华证保分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	中证800证券保险指数收益率×95%+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	鹏华证保	证保A	证保B
下属分级基金场内简称	证保分级	证保A	证保B
下属分级基金的交易代码	160625	150177	150178
报告期末下属分级基金的份额总额	819,528,888.25份	93,675,309.00份	93,675,309.00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。	鹏华证保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。	鹏华证保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	-36,772,519.85
2.本期利润	115,566,088.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.1083
4.期末基金资产净值	1,333,491,923.37
5.期末基金份额净值	1.324

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。

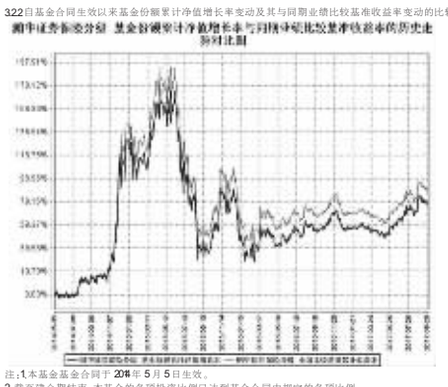
3.2基金净值表现

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	8.35%	1.10%	7.21%	1.10%	1.14%	0.00%

注:业绩比较基准=中证800证券保险指数收益率×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2014年5月5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
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		
余斌	本基金基金经理	2014年5月5日	-	10	余斌先生,国籍中国,经济学硕士,10年证券从业经验。曾任职于招商证券股份有限公司,担任风险控制部市场风险分析师;2009年10月加盟鹏华基金管理有限公司,历任机构理财部大客户经理、量化投资部量化研究员,先后从事特定客户资产管理业务产品设计、量化研究等工作;2014年5月起担任鹏华信息分级基金基金经理,2014年5月起兼任鹏华证券保险分级基金基金经理,2014年11月起兼任鹏华国防分级基金基金经理,2015年4月起兼任鹏华酒分级基金基金经理,2015年5月起兼任鹏华证券分级基金基金经理,2015年6月起兼任鹏华环保分级基金基金经理,2016年6月起兼任鹏华空天一体军工指数(LOF)、鹏华量化策略混合基金基金经理,余斌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

报告期内,基金运作严格按照基金合同的各项要求,依据被动化指数投资方法进行投资管理。

报告期内,市场行情趋于稳定,投资管理操作正常开展。基金日均跟踪偏离度和跟踪误差都有较好的控制,较好地实现了基金运作目标。

4.5报告期内基金的业绩表现

报告期末,基金份额净值为1.324,累计净值1.825。本报告期基金份额净值增长率为8.35%,本报告期,基金年化跟踪误差0.94%,日均跟踪偏离0.04%。

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	1,265,625,369.48	94.64
	其中:股票	1,265,625,369.48	94.64
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	69,820,375.51	5.22
8	其他资产	1,923,822.25	0.14
9	合计	1,337,369,567.24	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1按市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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	-	-
J	金融业	1,264,489,836.13	94.83
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,264,489,836.13	94.83

5.2.2按市期末积极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	-	-
B	采矿业	39,793.60	0.00
C	制造业	802,562.71	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	33,357.72	0.00
F	批发和零售业	26,385.45	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.00
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	115,299.99	0.01
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,135,533.35	0.09

5.2.3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	601318	中国平安	3,753,617	203,295,896.72	15.25
2	600030	中信证券	5,947,360	108,182,478.40	8.11
3	600837	海通证券	6,114,764	90,376,211.92	6.78
4	601601	中国太保	2,375,457	87,725,627.01	6.58
5	601211	国泰君安	3,407,595	73,706,279.85	5.53
6	601688	华泰证券	2,468,175	55,830,118.50	4.19
7	000776	广发证券	2,236,265	42,444,309.70	3.18
8	600958	东方证券	2,352,028	37,773,569.68	2.83
9	600999	招商证券	1,728,767	36,978,326.13	2.77
10	601336	新华保险	630,405	35,725,051.35	2.68

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	603882	金域医学	2,763	115,299.99	0.01
2	603106	恒银金融	2,786	84,025.76	0.01
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	002899	英派斯	1,408	64,528.64	0.00

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:无。

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
1.海通证券
本组合投资的前十名证券之一海通证券股份有限公司(以下简称"海通证券")于2017年5月23日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"证监会")行政处罚事先告知书(处罚字[2017]59号)(以下简称《告知书》)。根据《告知书》:海通证券违反了《证券公司融资融券业务管理办法》(证监会公告[2011]31号)第十一条的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(七)项"未按照规定与客户签订业务合同,或者未在与客户的业务合同中载入规定的必要条款"所进行方式。对于海通证券上述行为直接负责的主管人员为左秀海,其他直接责任人员为徐晓晓、朱元灏。根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度,依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定,中国证监会决定对广发证券责令改正,给予警告,没收违法所得5096563.6元,并处罚款25480265.75元;二、对左秀海、徐晓晓、朱元灏给予警告,并分别处以10万元罚款。海通证券于2016年11月28日收到中国证监会《行政处罚决定书》([2016]127号)(以下简称《决定书》)。根据《决定书》:海通证券上海雄田西路营业部和杭州解放路营业部对杭州佳禾网络技术服务有限责任公司HOMS系统开放接入。相关部门协作单中均未体现海通证券对HOMS系统平台软件进行认证,对于上述外部接入的第三方交易终端软件,海通证券未进行软件认证许可,未对外部系统接入实施有效管理,对相关客户身份情况缺乏了解。广发证券未采集客户交易终端信息,未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可追溯性,未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息。根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度,依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定,中国证监会决定对广发证券责令改正,给予警告,没收违法所得6805.95.75元,并处以20456.07.25元罚款。

对该投资的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究广发证券,认为本次行政处罚对该证券的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金,为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差,按照成份股权重进行配置该证券,符合指数基金的管理规定。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。

5.中信证券
本组合投资的前十名证券之一中信证券股份有限公司(以下简称"中信证券")于2017年5月25日公告称,公司日前收到到中国证监会《行政处罚事先告知书》(处罚字[2017]57号),一直未从事证券交易。根据《中信证券股份有限公司融资融券业务客户征信授信实施细则》(2010年3月发布,沿用至2016年3月25日,以下简称"《实施细则》")的规定,"在公司开户满半年(或点期间,开户满18个月)为开立信用账户的条件之一,中信证券在现货从事证券交易时间连续计算不足半年的情况下,为司度提供融资融券服务,于2012年3月12日为其开立了信用证券账户。2012年3月19日,中信证券与司度签订《融资融券业务合同》,我使司度得以开展融券交易。《实施细则》由当时中信证券信用交易管理部负责人宋成牵头制定,由分管副总经理宣新宏签批实施。"中信证券上述行为违反了《证券公司融资融券业务管理办法》(证监会公告[2011]31号),依据《证券公司监督管理条例》第八十四条第(七)项的规定,中国证监会拟决定:一、责令中信证券改正,给予警告,没收违法所得人民币6192558.18元,并处人民币3062762.18元罚款;二、对宣新宏、宋成给予警告,并分别处以人民币10万元罚款。

对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究中信证券,认为本次行政处罚对该证券的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金,为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差,按照成份股权重进行配置该证券,符合指数基金的管理规定。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。

5.12
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。

5.13其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	276,299.38
2	应收证券清算款	198,507.54
3	应收股利	-
4	应收利息	14,184.53
5	应收申购款	1,434,830.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,923,822.25

5.14报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:无。

5.15报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.16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
注:无。

5.17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:无。

5.18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	鹏华证保	证保A	证保B
报告期期初基金份额总额	1,260,255,472.66	118,464,879.00	118,464,879.00
报告期期间基金总申购份额	170,341,518.57	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	660,647,242.98	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	49,579,140.00	-24,789,570.00	-24,789,570.00
报告期期末基金份额总额	819,528,888.25	93,675,309.00	93,675,309.00

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及不定期折算变动的份额

§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
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
无。

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)《鹏华中证800证券保险指数分级证券投资基金基金合同》;
(二)《鹏华中证800证券保险指数分级证券投资基金托管协议》;
(三)《鹏华中证800证券保险指数分级证券投资基金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68号深圳国际商会中心43层鹏华基金管理有限公司
北京市西城区闹市口大街1号院1号楼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

鹏华中证800地产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	鹏华地产分级
场内简称	房地产
交易代码	160628
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月12日
报告期末基金份额总额	202,134,408.70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。 本基金力争鹏华地产分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	中证800地产指数收益率×95%+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	鹏华地产	地产A	地产B
下属分级基金场内简称	房地产	地产A	地产B
下属分级基金的交易代码	160628	150192	150193
报告期末下属分级基金的份额总额	144,458,388.70份	28,838,010.00份	28,838,010.00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。	鹏华地产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。	鹏华地产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。

注:本基金在交易所行情系统净值提示等其他信息披露场合下,上市交易开封闭运作的基金份额可分别简称为"地产A"、"地产B"。

§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	4,419,038.63
2.本期利润	2,336,186.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.0129
4.期末基金资产净值	220,867,407.36
5.期末基金份额净值	1.093

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。

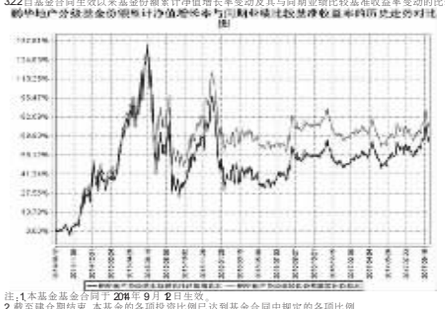
3.2基金净值表现

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	2.44%	1.18%	0.59%	1.15%	1.85%	0.03%

注:业绩比较基准=中证800地产指数收益率*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2014年9月12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		
陈龙	本基金基金经理	2016年9月24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

报告期内,基金运作严格按照基金合同的各项要求,依据被动化指数投资方法进行投资管理。

报告期内,市场行情趋于稳定,投资管理操作正常开展。基金日均跟踪偏离度和跟踪误差都有较好的控制。

4.5报告期内基金的业绩表现

报告期末,基金份额净值为1.093,累计净值1.093。本报告期基金份额净值增长率为2.44%,同期业绩比较基准收益率为0.59%。

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	208,929,931.34	93.55
	其中:股票	208,929,931.34	93.55
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	12,802,225.07	5.73
8	其他资产	1,597,054.04	0.72
9	合计	223,329,210.45	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,947,486.00	0.88
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	202,280,433.77	91.58
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	-	-
S	综合	3,631,006.86	1.64
	合计	207,858,926.63	94.11

5.2.2报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金乘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1.0930元,累计净值1.7540元;本报告期基金份额净值增长率为2.44%,同期业绩比较基准收益率为0.59%。

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	208,929,931.34	93.55
	其中:股票	208,929,931.34	93.55
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	12,802,225.07	5.73
8	其他资产	1,597,054.04	0.72
9	合计	223,329,210.45	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	-	-
B	采矿业	39,793.60	0.02
C	制造业	738,034.07	0.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	33,357.72	0.02
F	批发和零售业	26,385.45	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.01
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	115,299.99	0.05
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.02
S	综合	-	-
	合计	1,071,004.71	0.48

5.2.3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

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	000002	万科A	1,449,048	38,037,510.00	17.22
2	600048	保利地产	1,988,667	20,682,136.80	9.36
3	001979	招商蛇口	662,805	12,116,075.40	5.49
4	600340	华夏幸福	330,398	10,268,769.84	4.65
5	600606	绿地控股	1,020,400	7,673,408.00	3.47
6	600383	金地集团	630,824	7,235,551.28	3.28
7	000540	中天金融	689,633	5,268,796.12	2.39
8	600208	新湖中宝	1,201,837	5,155,880.73	2.33
9	002146	荣盛发展	486,209	4,648,158.04	2.10
10	600663	陆家嘴	205,038	4,584,649.68	2.08

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	603882	金域医学	2,763	115,299.99	0.05
2	603106	恒银金融	2,786	84,025.76	0.04
3	002900	哈三联	1,983	83,087.70	0.04
4	300702	天宇股份	1,124	68,968.64	0.03
5	603055	台华新材	2,658	62,489.58	0.03

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合
无。

5.5