

鹏华中证移动互联网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	
基金管理人及基金托管人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,基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,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。	
本报告财务资料未经审计。 本报告自2017年7月1日起至9月30日止。	
§2 基金产品概况	
基金简称	鹏华互联网分级
场内简称	互联网
交易代码	160636
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月16日
报告期末基金份额总额	152,629,747.65份
投资目标	本基金主要投资于移动互联网指数成份股,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的绝对值控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法,按照标的指数的成份股及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重进行相应调整。当标的指数成份股发生调整或成份股发生增发、增发、分红等事件时,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,或因某些成份股被调出标的指数或流动性不足时,或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对该投资组合管理进行适当调整和灵活,力求降低跟踪误差。
业绩比较基准	中证移动互联网指数收益率*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、债券型基金及货币市场基金,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	鹏华互联网分级
下属分级基金场内简称	互联网
下属分级基金的交易代码	160636
报告期末下属分级基金的资产总额	137,369,098.46元
报告期末下属分级基金的份额总额	137,369,098.46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、债券型基金及货币市场基金,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,具有与标的指数及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	-2,516,962.98
2.本期利润	10,575,816.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.0699
4.期末基金资产净值	168,582,016.61
5.期末基金份额净值	1.05

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),计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

§4 基金管理人

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
陈亮	本基金基金经理	2016年10月14日	8	陈亮先生,国籍中国,经济学博士,8年证券从业经历,曾任招商证券软件公司金融工程,2009年12月加盟鹏华基金管理有限公司,历任数据策略部基金经理和基金运营部,2016年7月起兼任鹏华互联网分级基金基金经理,2016年9月起兼任鹏华互联网分级基金基金经理,2016年10月起兼任鹏华互联网分级基金基金经理,陈亮先生具备基金从业资格,陈亮先生具备基金从业资格,5年前担任本基金基金经理未发生违法违规行为。

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事人员资格管理暂行办法的相关规定。

3.2.2 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,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,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投资基金合同约定的行为。

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、分配各环节得到公平对待。

§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	159,188,501.81	93.64
2	其中:股票	159,188,501.81	93.64
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,376,636.42	6.10
8	其他资产	435,369.44	0.26
9	合计	170,000,727.67	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	97,864,949.91	58.05
D	电力、热力、燃气及生产供应	-	-
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	信息技术、软件和信息技术服务业	34,091,059.42	20.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	479,481.50	0.28
L	租赁和商务服务业	3,994,646.76	2.37
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	1,759,801.75	1.04
R	文化、体育和娱乐业	10,068,312.72	5.97
S	综合	-	-
合计	-	158,813,559.48	94.21

5.2.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	97,864,949.91	58.05
D	电力、热力、燃气及生产供应	-	-
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	信息技术、软件和信息技术服务业	34,091,059.42	20.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	479,481.50	0.28
L	租赁和商务服务业	3,994,646.76	2.37
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	1,759,801.75	1.04
R	文化、体育和娱乐业	10,068,312.72	5.97
S	综合	-	-
合计	-	158,813,559.48	94.21

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	600703	三七互娱	236,980	4,483,254.40	3.25
2	000725	京东方A	1,209,000	5,319,600.00	3.16
3	002456	恺英网络	216,087	4,756,883.53	2.72
4	002415	海康威视	137,200	4,390,400.00	2.60
5	002230	科大讯飞	80,954	4,343,182.10	2.58
6	002241	聚友网络	210,600	4,262,544.00	2.53
7	002028	大康医疗	97,500	4,251,000.00	2.52
8	600374	华城集团	180,100	4,061,255.00	2.41
9	300136	信维通信	89,800	3,771,600.00	2.24
10	600487	宁波东力	108,800	3,742,720.00	2.22

5.3.2 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	002900	哈三联	1,983	83,087.70	0.05
2	300702	天孚通信	1,124	68,968.64	0.04
3	002901	哈三联	1,834	49,206.22	0.03
4	300700	哈三联	832	43,440.95	0.03
5	002906	哈三联	2,743	37,537.98	0.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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

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