鹏华盛世创新混合型证券投资基金（LOF）

2015 第四季度 报告

2015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
报告送出日期:2016年1月21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2016年1月18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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华盛世创新混合
场内简称	鹏华创新
基金主代码	160613
交易代码	160613
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2008年10月10日
报告期末基金份额总额	59,757,309.27份
投资目标	精选具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票,进行积极主动的投资管理,在有效控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	本基金的投资策略分为两个层次:第一层次是“自上而下”的资产配置策略,第二层次是“自下而上”的选股策略,主要投资于具有竞争力比较优势和持续盈利增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对低估的股票。在充分控制投资风险的基础上,通过积极主动的投资管理,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金,低于股票型基金,为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。
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（2015年10月1日 - 2015年12月31日）
1.本期已实现收益	4,872,898.93
2.本期利润	25,211,518.66
3.加权平均基金份额本期利润	0.4278
4.期末基金资产净值	119,042,039.95
5.期末基金份额净值	1.992

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。

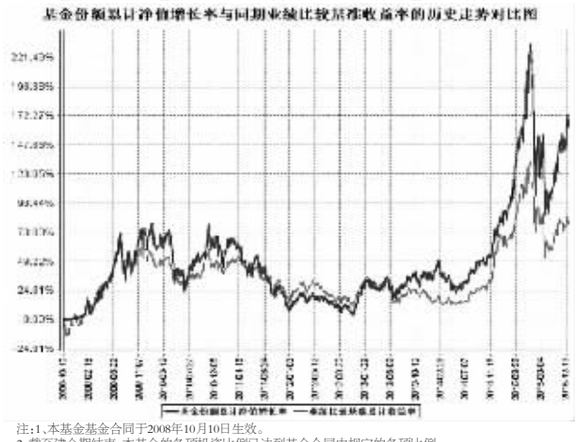
3.2 基金净值表现

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	27.28%	1.85%	12.98%	1.25%	14.30%	0.60%

注:业绩比较基准=沪深300指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%。

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2008年10月10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。

§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		
伍旋	本基金基金经理	2011年12月28日	-	9	伍旋先生,国籍中国,工商管理硕士,9年证券从业经验。曾任职于中国建设银行,2006年6月加盟鹏华基金管理有限公司,从事研究分析工作。历任研究部高级研究员,基金经理助理;2011年12月起担任鹏华盛世创新混合（LOF）基金基金经理,2015年2月起兼任鹏华可转债债券基金基金经理,2015年4月起兼任鹏华改革红利股票基金基金经理,现同时担任研究部副总经理。伍旋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%的交易次数为1次,主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济继续延续低位徘徊态势,同时稳增长政策的效果也在逐渐渗透。12月官方制造业PMI数值49.7%,11月为49.6%;12月官方非制造业PMI数值54.4%,创下2015年新高,11月为53.6%,虽然大型企业指数略有回落,但中、小型企业指数终于开始回升,新订单、新出口订单、产出指数均回升,且新订单回升幅度大于产出,在此情况下,短期内生产可能进一步提升。企业采购量与购进价格指数均出现明显上升,且12月煤炭、钢材价格出现明显上涨,微观层面数据也印证了企业生产经营状况有所好转。

2015年4季度内,股票市场由底部反弹。我们延续既定的投资策略,寻找更具有风险收益比的投资机会,调整了部分组合的持仓。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为27.28%,同期上证综指上涨15.93%,深证成指上涨26.80%,沪深300指数上涨16.49%。

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	109,724,854.09	91.22
	其中:股票	109,724,854.09	91.22
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	9,763,591.54	8.12
8	其他资产	801,799.43	0.67
9	合计	120,290,245.06	100.00

5.2 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、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	53,107,686.45	44.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,316,720.00	1.11
F	批发和零售业	7,980,061.54	6.70
G	交通运输、仓储和邮政业	4,696,861.37	3.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,684,762.83	8.98
J	金融业	13,201,951.30	11.09
K	房地产业	2,325,904.00	1.95
L	租赁和商务服务业	3,422,915.00	2.88
M	科学研究和技术服务业	3,531,124.00	2.97
N	水利、环境和公共设施管理业	3,049,851.20	2.56
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	6,407,016.40	5.38
S	综合	-	-
	合计	109,724,854.09	92.17

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	601098	中南传媒	268,076	6,407,016.40	5.38
2	600718	东软集团	173,104	5,374,879.20	4.52
3	000957	中通客车	198,600	4,851,798.00	4.08
4	600000	浦发银行	220,390	4,026,525.30	3.38
5	600066	宇通客车	162,309	3,650,329.41	3.07
6	600566	济川药业	131,485	3,636,875.10	3.06
7	601398	工商银行	779,000	3,567,820.00	3.00
8	300012	华测检测	143,600	3,531,124.00	2.97
9	002400	省广股份	136,100	3,422,915.00	2.88
10	601166	兴业银行	199,000	3,396,930.00	2.85

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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:本基金本报告期末未持有债券。

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:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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:本基金本报告期末未持有贵金属。

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:本基金本报告期末未持有权证。

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中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	57,720.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,271.45
5	应收申购款	741,807.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	801,799.43

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 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	60,659,815.24
报告期期间基金总申购份额	11,050,581.53
减:报告期期间基金总赎回份额	11,953,087.50
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	59,757,309.27

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

（一）《鹏华盛世创新混合型证券投资基金(LOF)基金合同》;

（二）《鹏华盛世创新混合型证券投资基金(LOF)托管协议》;

（三）《鹏华盛世创新混合型证券投资基金(LOF)2015年度第4季度报告》（原文）。

8.2 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

北京市西城区闹市口大街1号院1号楼中国建设银行股份有限公司

8.3 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
2016年1月21日

鹏华中证800地产指数分级证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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
报告送出日期:2016年1月21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2016年1月18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2015年10月1日起至12月31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		
基金主代码	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	385,350,851.98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。 当何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	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		
下属分级基金简称	房地产	地产A	地产B
下属分级场内简称	房地产	地产A	地产B
下属分级基金交易代码	160628	150192	150193
下属分级基金报告期末基金份额总额	275,114,917.98份	55,117,967.00份	55,117,967.00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揭示等其他信息披露场合下,上市交易并封闭运作的基金份额可分别简称为"地产A"、"地产B"。

3.1 主要财务指标

§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（2015年10月1日 - 2015年12月31日）
1.本期已实现收益	23,840,142.92
2.本期利润	104,193,731.95
3.加权平均基金份额本期利润	0.2997
4.期末基金资产净值	485,671,503.85
5.期末基金份额净值	1.260

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。

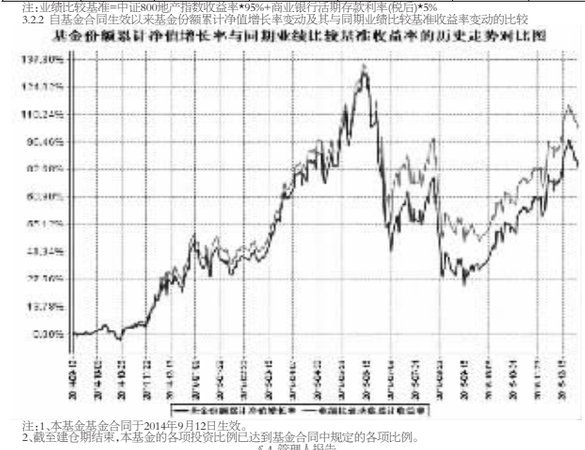
3.2 基金净值表现

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	37.86%	2.15%	37.41%	2.07%	0.45%	0.08%

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。

§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		
王咏辉	本基金基金经理	2014年9月12日	-	17	王咏辉先生,国籍英国,工程和计算机专业硕士,17年证券基金从业经验。曾担任摩根大通(JPMorgan)投资基金管理公司高级分析师,汇丰投资基金管理公司(HSBC)高级分析师,伦敦巴克莱国际投资基金管理公司基金经理、部门负责人,巴克莱资本公司(BarclaysCapital)部门负责人,泰达宏利基金公司国际投资部副总监、产品与金融工程部副总经理及泰达宏利中证财富大盘指数基金、泰达宏利全球新格局QDII基金、泰达中证500基金基金经理等职;2012年11月加盟鹏华基金管理有限公司,2013年12月起担任鹏华中证500指数（LOF）基金基金经理,2014年9月起兼任鹏华地产分级基金基金经理,2014年12月起兼任鹏华沪深300指数（LOF）基金基金经理,2015年6月起兼任鹏华创业板分级基金、鹏华互联网分级基金基金经理,现同时担任量化及衍生品投资部总经理、投资决策委员会成员。王咏辉先生具备基金从业资格,英国基金经理从业资格（IMC）。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%的交易次数为1次,主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年四季度中国经济在“稳增长”与“调结构”的背景下,疲弱前行,A股市场在3季度呈现出异常波动后,然后在四季度市场快速恢复到3539点。本基金秉承指数基金的投资策略,在报告期内连续遭遇一定比例申购赎回,对基金净值造成一定影响,管理人尽力降低影响,在力争跟踪指数收益的基础上,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1.260元,累计净值1.837元;本报告期基金份额净值增长率为+37.86%,业绩比较基准收益率+37.41%。

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	454,260,967.68	91.16
	其中:股票	454,260,967.68	91.16
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	32,379,238.29	6.50
8	其他资产	11,677,763.06	2.34
9	合计	498,317,969.03	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	-	-
K	房地产业	433,434,991.31	89.24
L	租赁和商务服务业	4,780,448.44	0.98
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	16,045,527.93	3.30
	合计	454,260,967.68	93.53

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	4,055,748	97,297,394.52	20.03
2	600048	保利地产	3,547,617	37,746,644.88	7.77
3	001979	招商蛇口	1,220,103	25,451,348.58	5.24
4	600649	城投控股	985,253	22,818,459.48	4.70
5	600340	华夏幸福	581,873	17,875,138.56	3.68
6	600383	金地集团	1,236,874	17,068,861.20	3.51
7	600895	张江高科	425,781	12,275,266.23	2.53
8	600663	陆家嘴	223,988	11,230,758.32	2.31
9	600158	中体产业	371,094	9,678,131.52	1.99
10	600503	华丽家族	704,700	9,654,390.00	1.99

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期内未发生股指期货投资。

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

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

本基金投资的前十名证券中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	931,852.38
2	应收证券清算款	8,579,100.48
3	应收股利	-
4	应收利息	10,425.17
5	应收申购款	2,156,385.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,677,763.06

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.11.5 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	000002	万 科A	97,297,394.52	20.03	重大事项
2	600649	城投控股	22,818,459.48	4.70	重大事项

5.11.6 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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.11.7 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	房地产	地产A	地产B
报告期期初基金份额总额	181,521,341.76	56,378,600.00	56,378,600.00
报告期期间基金总申购份额	495,282,636.90	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	389,631,067.84	-	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-12,057,992.84	-1,260,633.00	-1,260,633.00
报告期期末基金份额总额	275,114,917.98	55,117,967.00	55,117,967.00

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额和基金折算后调整份额。

§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

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 鹏华资产管理（深圳）有限公司及其产品持有鹏华地产分级基金情况

公司/产品名称	期末持有份额（份）		
	房地产	鹏华地产A	鹏华地产B
鹏华资产-上海银行-申毅量化套利五号资产管理计划	1	-	-

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)《鹏华中证800地产指数分级证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华中证800地产指数分级证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华中证800地产指数分级证券投资基金2015年第4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
2016年1月21日

证券代码:002111 证券简称:威海广泰 公告编号:2016-009

威海广泰空港设备股份有限公司
关于召开2016年第一次临时股东大会的提示性公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

威海广泰空港设备股份有限公司（以下简称“公司”）于2016年1月9日在《中国证券报》、《证券时报》及巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）上刊登了《关于召开2016年第一次临时股东大会的通知》,公司采取现场投票与网络投票相结合的方式召开2016年第一次临时股东大会。2016年1月9日,公司分别收到了控股股东新疆广泰空港股权投资有限合伙企业和股东李光太（实际控制人）的《关于股东大会增加临时提案的建议》,因此公司于2016年1月12日发布了《关于召开2016年第一次临时股东大会的补充通知》,现将召开本次会议有关情况作提示性公告如下:

一、召开会议的基本情况

1.股东大会届次:威海广泰空港设备股份有限公司（以下简称“公司”）2016年第一次临时股东大会

2、会议召集人:公司董事会。2016年1月8日公司第五届董事会第十二次临时会议,以9票同意决议召开股东大会。

3、会议召开的合法、合规性:本次股东大会会议的召开符合有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和公司章程。

4、会议召开的日期、时间:2016年1月25日（星期一）下午14:00

网络投票时间为:2016年1月24日—2016年1月25日,其中,通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的具体时间为:2016年1月25日上午9:30-11:30,下午13:00-15:00;通过深圳证券交易所互联网投票系统进行网络投票的具体时间为2016年1月24日下午15:00至2016年1月25日下午15:00的任意时间。

5、会议的召开方式:本次股东大会采用现场表决与网络投票相结合的方式召开,公司将通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统向公司股东提供网络形式的投票平台,公司股东可以在上述网络投票时间内通过深圳证券交易所的交易系统或互联网投票系统行使表决权。公司股东应选择现场投票、网络投票中的一种方式,如果同一表决权出现重复投票表决的,以第一次投票表决结果为准。

6、出席对象:

（1）在股权登记日持有公司股份的股东。本次股东大会的股权登记日为2016年1月19日,于股权登记日下午收市时在中国结算深圳分公司登记在册的公司全体股东均有权出席股东大会,并可以以书面形式委托代理人出席会议和参加表决,该股东代理人不必是本公司股东。

（2）本公司董事、监事和高级管理人员。

（3）本公司聘请的律师。

7、会议地点:山东省威海市黄河街16号威海广泰空港设备股份有限公司三楼会议室。

二、会议审议事项

（一）议案名称

1、审议《关于2015年度非公开发行股票涉及用地和房地产销售之专项自查报告》;

2、审议《公司实际控制人关于房地产业务相关事项的承诺函》;

3、审议《公司控股股东关于房地产业务相关事项的承诺函》;

4、审议《公司董事和高级管理人员关于房地产业务相关事项的承诺函》;

（1）公司董事承诺

（2）公司高级管理人员承诺

5、审议《公司监事关于房地产业务相关事项的承诺函》;

6、审议《关于变更年度审计机构的议案》。

特别说明:

1、议案2由股东李光太（实际控制人,单独持有公司14.55%的股份）提出并书面提交公司董事会;

2、议案3由股东新疆广泰空港股权投资有限合伙企业（单独持有公司32.19%的股份）提出并书面提交公司董事会;

3、议案4的各项子议案需逐项审议表决;

4、议案6属于涉及影响中小投资者利益的重大事项,对中小投资者（单独或合计持有上市公司5%以上股份的股东及公司董事、监事、高级管理人员以外的其他股东）的表决票单独计票,公司将根据计票结果进行公开披露。

（二）披露情况

议案1、4、6已经公司第五届董事会第十二次临时会议审议通过;议案5已经公司第五届监事会第八次临时会议审议通过;详细内容请参见公司2016年1月9日刊登在《中国证券报》、《证券时报》及巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）上的公司公告。

议案2、3详细内容请参见公司2016年1月12日刊登在《中国证券报》、《证券时报》及巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）上的公司公告。

三、会议登记方法

1、登记时间:2016年1月20日-1月21日上午9:00-11:30,下午2:00-5:00;

2、登记地点:山东省威海市环翠区黄河街16号威海广泰空港设备股份有限公司董事会办公室;

3、登记办法:

（1）自然人股东持本人身份证、股东账户卡、持股凭证等办理登记手续;

（2）法人股东凭营业执照复印件（加盖公章）、单位持股凭证、法人授权委托书和出席人身份证原件办理登记手续;

（3）委托代理人凭本人身份证原件、授权委托书、委托人股东账户卡及持股凭证等办理登记手续;

（4）异地股东可凭以上有关证件采取信函或传真方式登记（须在2016年1月21日下午5点前