鹏华中证酒指数分级证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3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4月20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4月15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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华酒分级
场内简称	鹏华酒分级
基金主代码	160632
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月29日
报告期末基金份额总额	478,372,126.42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。 本基金力争鹏华酒分级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	中证酒指数收益率×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
下属分级基金简称	鹏华酒分级 鹏华酒A 鹏华酒B
下属分级场内简称	酒分级 酒A 酒B
下属分级基金交易代码	160632 150229 150230
下属分级基金报告期末基金份额总额	280,246,645.42份 99,062,740.00份 99,062,741.00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。 鹏华酒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。 鹏华酒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(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-13,832,323.62
2.本期利润	-46,771,912.88
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1030
4.期末基金资产净值	373,322,622.39
5.期末基金份额净值	0.780

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。

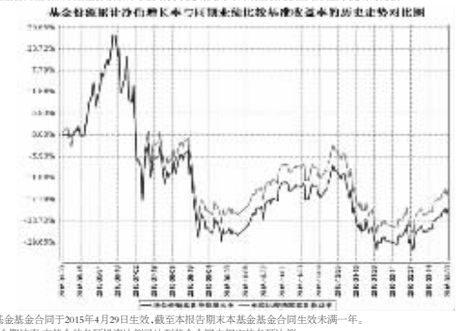
3.2 基金净值表现

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	-10.96%	2.51%	-10.72%	2.41%	-0.24%	0.10%

注:业绩比较基准=中证酒指数收益率*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2015年4月29日生效,截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。

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		
余斌	本基金基金经理	2015年4月29日	-	9	余斌先生,国籍中国,经济学硕士,9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,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 管理人对投资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

报告期内,本基金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0.780,累计净值0.796。本报告期基金份额净值增长率为-10.96%。

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	353,524,256.75	88.44
	其中:股票	353,524,256.75	88.44
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	45,771,406.84	11.45
8	其他资产	456,508.89	0.11
9	合计	399,752,172.48	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	342,322,706.00	91.70
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	11,201,550.75	3.00
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	353,524,256.75	94.70

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

注: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	600519	贵州茅台	178,118	44,109,141.52	11.82
2	000858	五粮液	1,495,817	42,047,415.87	11.26
3	002304	洋河股份	581,293	38,830,372.40	10.40
4	000568	泸州老窖	1,374,445	33,880,069.25	9.08
5	000729	燕京啤酒	2,762,304	20,302,934.40	5.44
6	600600	青岛啤酒	545,757	15,663,225.90	4.20
7	002568	百润股份	526,948	13,479,329.84	3.61
8	600238	海南椰岛	878,553	11,201,550.75	3.00
9	600559	老白干酒	206,086	10,644,341.90	2.85
10	000869	张 裕A	266,737	9,853,264.78	2.64

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

注: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

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

本基金按资产配置原则,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

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	112,775.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,368.02
5	应收申购款	338,365.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	456,508.89

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 报告期末股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 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:本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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

项目	鹏华酒分级	鹏华酒A	鹏华酒B
报告期期初基金份额总额	260,063,750.43	101,940,559.00	101,940,560.00
报告期期间基金总申购份额	149,743,071.07	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	135,315,814.08	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	5,755,638.00	-2,877,819.00	-2,877,819.00
报告期期末基金份额总额	280,246,645.42	99,062,740.00	99,062,741.00

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§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末申购、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)《鹏华中证酒指数分级证券投资基金基金合同》;

(二)《鹏华中证酒指数分级证券投资基金托管协议》;

(三)《鹏华中证酒指数分级证券投资基金2016年第1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4月20日

鹏华中证新能源指数分级证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31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:2016年4月20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2016年4月15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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华新能源分级
场内简称	新能源
基金主代码	160640
交易代码	160640
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月29日
报告期末基金份额总额	77,736,143.27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。 本基金力争鹏华新能源分级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	中证新能源指数收益率×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	招商银行股份有限公司
下属分级基金简称	新能源 新能A 新能B
下属分级场内简称	新能源 新能A 新能B
下属分级基金交易代码	160640 150279 150280
下属分级基金报告期末基金份额总额	45,859,375.27份 15,938,384.00份 15,938,384.00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。 鹏华新能源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。 鹏华新能源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(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-6,199,893.69
2.本期利润	-14,174,058.85
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1812
4.期末基金资产净值	68,865,849.04
5.期末基金份额净值	0.886

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。

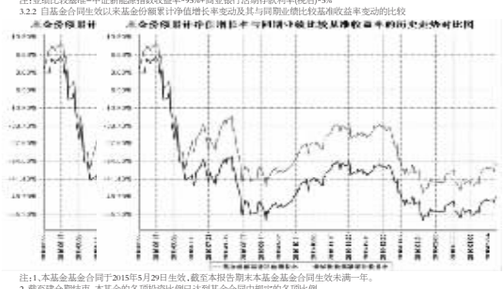
3.2 基金净值表现

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	-18.57%	3.44%	-17.82%	3.39%	-0.75%	0.05%

注:业绩比较基准=中证新能源指数收益率*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2015年5月29日生效,截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。

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		
焦文龙	本基金基金经理	2015年5月29日	-	7	焦文龙先生,国籍中国,经济学硕士,7年证券从业经验。2009年6月加盟鹏华基金管理有限公司,历任监察稽核部金融工程师、量化及衍生品投资部投资量化研究员,先后从事金融工程、量化研究等工作;2015年5月起担任鹏华一带一路分级基金基金经理,2015年5月起兼任鹏华高铁产业分级基金、鹏华新能源分级基金基金经理,2015年8月起兼任鹏华新经济分级基金、鹏华铁铁分级基金基金经理,2015年11月起兼任鹏华国企改革分级基金基金经理,焦文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 管理人对投资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。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

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0.995,累计净值0.622。本报告期基金份额净值增长率为-14.05%。

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)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	64,718,611.18	90.75
	其中:股票	64,718,611.18	90.75
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	6,233,889.04	8.74
8	其他资产	365,532.52	0.51
9	合计	71,318,032.74	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	718,432.00	1.04
C	制造业	52,097,480.61	75.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,359,006.94	7.78
E	建筑业	437,373.00	0.64
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	3,343,332.00	4.85
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	403,705.00	0.59
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	2,287,526.75	3.32
	合计	64,646,856.30	93.87

5.2.2 报告期末积极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	采掘业	-	-
C	制造业	57,671.44	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	14,083.44	0.02
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	-	-
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	71,754.88	0.10

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	002594	比亚迪	51,500	3,028,715.00	4.40
2	601985	中国核电	385,500	2,976,060.00	4.32
3	601727	上海电气	248,648	2,344,750.64	3.40
4	002466	天齐锂业	13,019	2,184,588.20	3.17
5	002202	金风科技	129,200	2,121,464.00	3.08
6	600089	特变电工	214,600	1,955,006.00	2.84
7	600406	国电南瑞	120,310	1,732,464.00	2.52
8	000839	中信国安	90,600	1,610,868.00	2.34
9	000559	万向钱潮	94,700	1,584,331.00	2.30
10	000009	中国宝安	105,100	1,443,023.00	2.10

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	603861	白云电器	946	22,562.10	0.03
2	300506	名家汇	707	14,083.44	0.02
3	002791	坚朗五金	341	12,818.19	0.02
4	300474	N景嘉微	491	9,643.24	0.01
5	603028	赛福天	1,196	7,331.48	0.01

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

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

1.广发证券

本报告投资的前十名证券之一广发证券股份有限公司(以下简称"广发证券")于2015年9月10日收到中国证监会《行政处罚事先告知书》(处罚字[2015]71号)。根据《告知书》,"广发证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条、《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条、《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第(四)项、《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为。中国证监会对"广发证券予令整改,给予警告,没收违法所得6,865,135.75元,并处以20,415,407.25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。

2.海通证券

本报告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2015年9月10日收到中国证监会监管理委员会(以下简称"证监会")《行政处罚事先告知书》(处罚字【2015】73号)(以下简称《告知书》)。根据《告知书》,海通证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条、《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条、《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第(四)项、《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为。中国证监会对海通证券责令改正,给予警告,没收违法所得26,833,000元,并处以85,959,000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海通证券,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。

3.华泰证券

本报告投资的前十名证券之一华泰证券股份有限公司(以下简称"华泰证券")于2015年9月10日收到中国证监监管理委员会(以下简称"证监会")《行政处罚事先告知书》(处罚字【2015】72号)(以下简称《告知书》)。根据《告知书》,华泰证券未按照《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条、《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身份信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为。中国证监会对华泰证券责令改正,给予警告,没收违法所得18,235,275.00元,并处以54,705,825.00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华泰证券,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。

4.长江证券

本基金投资的前十名证券之一的长江证券股份有限公司(以下简称"长江证券")于2015年5月6日受到中国证监会对长江证券相关研究报告的制作、审批和发布等情况的合规性执查。从检查情况看,媒体转载内容未源于5月4日长江证券发布的题为《上证成交可上1.4万亿,创新低已达巅峰——从交易成本看当前市场系列之二》的研究报告。检查中发现,长江证券未与转载机构签订协议,未明确转载费任务,致使转载机构篡改了研究报告标题;研报报送审核人员不符合公司内部规定,未能严格执行其内部管理制度。上述行为反映出公司内部控制制度未能有效执行,并违反了中国证监会《发布证券研究报告暂行规定》(证监会公告[2010]28号)第二十一条、"证券公司、证券投资咨询机构投权其他机构刊载或者转发证券研究报告或者摘要,应当与相关机构作出协议约定,明确刊载或者转发责任"之规定。根据《发布证券研究报告暂行规定》(证监会公告[2010]28号)第二十二条的规定,中国证监会对长江证券采取了出具警示函的行政监管措施。根据《证监会公告》,长江证券已按照相关规定和中国证监会的要求,采取了措施,严格执行内部控制制度,加强研报刊载或者转发管理,确保业务开展依法合规。2016年1月,中国证监会湖北监管局(以下简称湖北证监局)下发了《关于对长江证券股份有限公司采取责令增加内部合规检查的次数监管措施的决定》([2016]1号),认为公司在开展研究报告业务时,存在内部控制不完善的情形,违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条关于"证券公司应当按照审慎经营的原则,建立健全风险管理与内部控制制度,防范和控制风险"的规定。根据《证券公司监督管理条例》第七十条的规定,湖北证监局责令长江证券在2016年2月11日至2017年1月31日期间,每3个月对公司研究报告业务增加一次内部合规检查,并在每次检查后10个工作日内向湖北证监局报送合规检查报告。2016年3月,中国证监会湖北监管局(以下简称湖北证监局)下发了《关于对长江证券股份有限公司采取出具警示函监管措施的决定》([2016]3号),认为公司作为武汉四方交通物流有限责任公司(以下简称四方物流)2014年中小企业私募债项目的受托管理人,在履行受托管理职责的过程中未勤勉尽责,未按照《四方物流2014年中小企业私募债券受托管理协议》的约