鹏华中证银行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	鹏华银行分级		
场内简称	银行指基		
交易代码	160631		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年4月17日		
报告期末基金份额总额	7,118,208,114.67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。 本基金力争鹏华银行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	中证银行指数收益率×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	鹏华银行	银行A	银行B
下属分级场内简称	银行指基	银行A	银行B
下属分级基金交易代码	160631	150227	150228
下属分级基金报告期末基金份额总额	1,142,938,590.67份	2,987,634,762.00份	2,987,634,762.00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。	鹏华银行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。	鹏华银行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	-317,873,709.69
2.本期利润	-660,053,648.55
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0878
4.期末基金资产净值	5,774,215,459.33
5.期末基金份额净值	0.811

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	-8.47%	1.64%	-7.93%	1.55%	-0.54%	0.09%

注:业绩比较基准=中证银行指数收益率*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17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		
崔俊杰	本基金基金经理	2015年4月17日	-	8	崔俊杰先生,国籍中国,管理学硕士,8年证券从业经验。2008年7月加盟鹏华基金管理有限公司,历任产品规划部产品设计师、量化投资部量化研究员,先后从事产品设计、量化研究工作。2013年3月起担任鹏华深证民营ETF基金及其联接基金基金经理,2013年3月起兼任鹏华上证民企50ETF基金及其联接基金基金经理,2013年7月起兼任鹏华沪深300ETF基金基金经理,2014年12月起兼任鹏华资源分级基金基金经理,2014年12月起兼任鹏华传媒分级基金基金经理,2015年4月起兼任鹏华银行分级基金基金经理,2015年8月起兼任鹏华医药分级基金基金经理。崔俊杰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
2016年1季度,整个A股市场先抑后扬,季末呈现震荡向上的局面。本基金秉承指数基金的投资策略,在应对申购赎回的基础上,力争跟踪指数收益,并将基金跟踪误差控制在合理范围内。
2016年1季度市场波动仍然较高,对基金的管理运作带来一定影响,面临这种情况,我们进行了精心的管理,较好的实现了跟踪误差控制目标。

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0.811元,累计净值0.826元,银行A/B值为1.019元,银行B/B值为0.603元。本报告期基金份额净值增长率为-8.47%。
报告期内,本基金日均跟踪偏离度的绝对值0.0088%,年化跟踪误差2.885%,完成了跟踪目标。
对本基金而言,报告期内跟踪误差的主要来源为:样本股特殊事件导致的停复牌、成分股调整以及为应对申购赎回必要的现金留存等,对此我们采取了进一步的优化策略进行应对。

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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,482,143,496.28	94.74
	其中:股票	5,482,143,496.28	94.74
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	293,392,959.85	5.07
8	其他资产	10,863,942.09	0.19
9	合计	5,786,400,398.22	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按一级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	采掘业	-	-
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	5,481,730,955.22	94.93
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	5,481,730,955.22	94.93

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

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	376,306.58	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,234.48	0.00
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	412,541.06	0.01

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	600016	民生银行	99,660,349	907,905,779.39	15.72
2	601166	兴业银行	45,053,148	699,675,388.44	12.12
3	600000	浦发银行	33,195,395	595,193,432.35	10.31
4	600036	招商银行	34,843,820	560,637,063.80	9.71
5	601328	交通银行	79,557,144	443,133,292.08	7.67
6	601288	农业银行	129,137,179	413,238,972.80	7.16
7	601169	北京银行	34,246,938	345,209,135.04	5.98
8	601398	工商银行	72,863,243	312,583,312.47	5.41
9	601988	中国银行	71,199,743	242,079,126.20	4.19
10	000001	平安银行	19,329,904	205,670,178.56	3.56

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	002791	坚朗五金	3,973	149,345.07	0.00
2	002792	通宇通讯	3,081	135,440.76	0.00
3	300474	景嘉微	2,467	48,451.88	0.00
4	300506	名家汇	1,819	36,234.48	0.00
5	603798	康普顿	1,590	22,784.70	0.00

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将会和拟战略明细
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将会和拟战略明细
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之一的长视网信息技术(北京)股份有限公司(以下简称"乐视网")于2015年收到中国证监会北京监管局[2015]30号行政监管措施决定书,认为长视网存在以下问题:公司未在2014年年度报告中单独披露影响利润表的减值测试方法、依据和参数。根据《上市公司现场检查办法》的相关规定,要求公司就上述事项对投资者进行公开说明;公司的付费业务收入政策披露不明确;研发费用资本化内容不明确。根据乐视网公告,其对北京证监局提出的问题采取了相应的整改措施。
对该股票的投资决策程序的说明:本基金为指数基金,为更好地跟踪标的指数,控制跟踪误差对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置,符合指数基金的管理规定,该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,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之一的恒电子股份有限公司控股子公司杭州恒电网络技术服务有限公司(以下简称"恒电网络")于2015年9月7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[2015]68号)。恒电网络开发运营的HOMS系统,包含子账户开立、提供委托交易、存储、查询、清算等多种证券业务属性的功能。恒电网络明知客户经营方式,仍向不具有经营证券资质的客户销售该系统,提供相关服务,并获取收益的行为违反了《证券法》第一百一十一条的规定,构成《证券法》第一百九十七条所述非法经营证券业务的行为。时任恒电网络董事长刘晓峰为直接负责的主管人员,总经理官晓国为其他直接责任人员。
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《证券法》第一百九十七条的规定,我会拟决定:
一、没收恒电网络违法所得132,852,384.06元,并处以398,557,152.18元罚款;
二、对刘晓峰处7警告,并处以30万元罚款;
三、对官晓国处7警告,并处以30万元罚款。
对该股票的投资决策程序的说明:本基金为指数基金,为更好地跟踪标的指数,控制跟踪误差对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置,符合指数基金的管理规定,该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,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。
5.11.2
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	434,332.98
2	应收证券清算款	9,293,425.51
3	应收股利	-
4	应收利息	66,416.59
5	应收申购款	1,069,767.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,863,942.09

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
注:本基金本报告期末股票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

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	603798	康普顿	22,784.70	0.00	新股未上市

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	鹏华银行	银行A	银行B
报告期期初基金份额总额	1,246,614,888.10	3,674,081,596.00	3,674,081,596.00
报告期期间基金总申购份额	630,261,988.99	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	2,106,831,954.42	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	1,372,893,668.00	-686,446,834.00	-686,446,834.00
报告期期末基金份额总额	1,142,938,590.67	2,987,634,762.00	2,987,634,762.00

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
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手续费
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 鹏华资产管理(深圳)有限公司及其产品持有鹏华银行分级的情况

公司/产品名称	期末持有份额(份)		
	银行指基	银行A级	银行B级
鹏华资产-海通证券-鹏华资产海通MOM私募精选之华夏未来盈	-	320,000.00	-

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
(一)《鹏华中证银行指数分级证券投资基金基金合同》;
(二)《鹏华中证银行指数分级证券投资基金托管协议》;
(三)《鹏华中证银行指数分级证券投资基金2016年度第1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4月20日

鹏华中证移动互联网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	鹏华互联网分级		
场内简称	互联网		
基金主代码	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	239,163,353.79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。 本基金力争鹏华互联网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	互联网	互联A	互联B
下属分级场内简称	互联网	互联A	互联B
下属分级基金交易代码	160636	150245	150246
下属分级基金报告期末基金份额总额	180,779,795.79份	29,191,779.00份	29,191,779.00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。	鹏华互联网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。	鹏华互联网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	-13,114,097.17
2.本期利润	-58,759,816.02
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2760
4.期末基金资产净值	266,530,635.77
5.期末基金份额净值	1.114

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	-18.53%	3.62%	-18.53%	3.09%	-1.09%	0.53%

注: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%
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6月16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		
王咏辉	本基金基金经理	2015年6月16日	-	18	王咏辉先生,国籍美国,工程和计算机专业硕士,18年证券基金从业经验。曾担任伦敦摩根大通(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,泰达宏利基金公司固转投资部副总监,产品与金融工程部副总经理及泰达宏利中证财富大众指数基金、泰达宏利全球债券EQDII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
2016年一季度市场波动仍然较高,对基金的管理运作带来一定影响,面临这种情况,我们进行了精心的管理,较好的实现了跟踪误差控制目标。

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0.909元,累计净值0.909元,银行A/B值为1.019元,银行B/B值为0.603元。本报告期基金份额净值增长率为-19.62%。
报告期内,本基金日均跟踪偏离度的绝对值0.088%,年化跟踪误差3.885%,完成了跟踪目标。
对本基金而言,报告期内跟踪误差的主要来源为:样本股特殊事件导致的停复牌、成分股调整以及为应对申购赎回必要的现金留存等,对此我们采取了进一步的优化策略进行应对。

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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	245,806,621.39	89.85
	其中:股票	245,806,621.39	89.85
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	25,699,924.46	9.39
8	其他资产	2,052,871.72	0.75
9	合计	273,559,417.57	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	2,098,218.25	0.79
B	采矿业	-	-
C	制造业	64,807,314.25	24.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,058,883.94	2.65
F	批发和零售业	9,379,791.72	3.52
G	交通运输、仓储和邮政业	1,512,420.00	0.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	125,125,482.18	46.95
J	金融业	-	-
K	房地产业	9,246,872.44	3.47
L	租赁和商务服务业	10,122,828.68	3.80
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	2,525,956.00	0.95
R	文化、体育和娱乐业	13,882,438.76	5.21
S	综合	-	-
	合计	245,760,206.22	92.21

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

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	46,415.17	0.02
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	-	-
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	46,415.17	0.02

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	300104	乐视网	174,558	8,101,236.78	3.04
2	002024	苏宁云商	659,286	7,548,824.70	2.83
3	300059	东方财富	151,697	6,720,177.10	2.52
4	600570	恒生电子	106,400	6,207,376.00	2.33
5	600271	航天信息	105,865	6,161,343.00	2.31
6	300017	网宿科技	102,009	5,958,345.69	2.24
7	002230	科大讯飞	167,754	5,438,584.68	2.04
8	600804	鹏博士	241,200	5,120,676.00	1.92
9	002241	歌尔声学	197,175	5,047,680.00	1.89
10	002385	大北农	353,095	4,166,521.00	1.56

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	300474	N景嘉微	982	19,286.48	0.01
2	603028	赛福天	2,691	16,495.83	0.01
3	603798	康普顿	742	10,632.86	0.00

注:上述股票明细为本基金本报告期末持有的全部股票。
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将会和拟战略明细
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