鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金

2017 第四季度 报告

2017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:2018年1月22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2018年1月17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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华环保分级
场内简称	环保分级
交易代码	166634
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	123,458,183.51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。 本基金力争鹏华环保份额净值增长率与预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	中证环保产业指数收益率×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
下属分级基金的基金简称	鹏华环保分级	鹏华环保A	鹏华环保B
下属分级基金场内简称	环保分级	环保A级	环保B级
下属分级基金的交易代码	166634	150237	150238
报告期末下属分级基金的份额总额	114,778,409.51份	4,339,887.00份	4,339,887.00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。	鹏华环保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。	鹏华环保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10月1日-2017年12月31日)
1.本期已实现收益	-1,604,309.14
2.本期利润	-7,418,020.81
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0585
4.期末基金资产净值	137,723,562.19
5.期末基金份额净值	1.116

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。

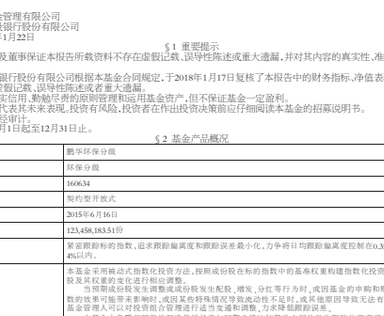
3.2 基金净值表现

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	-5.08%	1.05%	-5.42%	1.04%	0.34%	0.01%

注:业绩比较基准=中证环保产业指数收益率*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。
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		
余斌	本基金基金经理	2015年6月16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,2017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或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1.116,累计净值1.780,本报告期基金份额净值增长率为-5.08%,本报告期,基金年化跟踪误差0.55%,日均跟踪偏离0.03%。

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	130,596,935.51	94.15
	其中:股票	130,596,935.51	94.15
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	8,031,048.37	5.79
8	其他资产	80,382.76	0.06
9	合计	138,708,366.64	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	1,333,188.00	0.97
B	采矿业	-	-
C	制造业	81,542,740.78	59.21
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	20,701,106.15	15.03
E	建筑业	9,366,203.45	6.80
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	3,836,179.00	2.79
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	12,112,882.92	8.80
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	1,249,037.20	0.91
	合计	130,141,337.50	94.49

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	采矿业	-	-
C	制造业	389,162.26	0.28
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	34,112.55	0.02
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	32,323.20	0.02
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	455,598.01	0.33

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	002366	台海核电	62,200	1,645,190.00	1.19
2	300237	美晨生态	91,670	1,528,138.90	1.11
3	002341	新纶科技	54,100	1,487,750.00	1.08
4	002080	中材科技	56,000	1,475,600.00	1.07
5	002202	金风科技	78,070	1,471,619.50	1.07
6	300274	阳光电源	77,940	1,462,933.80	1.06
7	300203	聚光科技	40,800	1,450,440.00	1.05
8	600388	龙净环保	83,250	1,440,225.00	1.05
9	600116	三峡水利	161,500	1,437,350.00	1.04
10	002573	清新环境	63,100	1,434,263.00	1.04

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	002916	深南电路	2,684	234,125.32	0.17
2	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.03
3	300735	光弘科技	2,634	37,903.26	0.03
4	300730	科创信息	821	34,112.55	0.02
5	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
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
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
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
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
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
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,降低申赎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
1.杉杉股份
本基金投资的前十名证券之一的宁波杉杉股份有限公司(以下简称"杉杉股份")于2017年8月22收到中国证券监督管理委员会宁波监管局(以下简称"宁波证监局")下发的《关于对宁波杉杉股份有限公司采取责令改正监管措施的决定》(〔2017〕19号)和《关于对杉杉股份有限公司采取责令改正监管措施的决定》(〔2017〕20号),具体内容包括"在募集资金使用用途方面,截至2017年5月底,你公司"年产35000吨锂离子动力电池材料项目"实际用于土建投资的募集资金金额为13,211.03万元,与公司方案披露的"杉杉股份负责项目的厂房土建、起投入9250万元"的内容不符。上述事项违反了《上市公司监管指引第2号——上市公司募集资金管理和使用的监管要求》第五条相关规定;2016年4月15日公告的股票业务与融资租赁业务分拆上市事项,2016年8月19日停牌涉及的Pampa Calichera股权收购事项,2016年12月13日公告的宁波光科卡尔阳能科技发展有限公司90.03%股权收购事项,均未制作和报送重大事项备忘录,违反了《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第十条相关规定;"根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条和《上市公司监管指引第4号——上市公司实际控制人、股东、关联方、收购人以及上市公司承诺及履行》第六条规定,宁波证监局决定对杉杉股份采取责令改正的监管措施,杉杉股份应在收到本决定之日起30日内向我局提交书面整改方案,并提升合规意识,避免同业竞争,做好关联方关系的识别和管理。

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杉杉股份,认为本次行政监管措施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.格林美
本基金投资的前十名证券之一的格林美股份有限公司(以下简称"格林美")于2017年8月21日收到深圳证监局下发《深圳证监局关于对格林美股份有限公司的监管关注函》(深证局公司字[2017]50号),对公司未在2017年1月初的5个交易日内披露公司2016年度累计新增借款占2015年末净资产超过20%事项表示关注,深圳证监局考虑到公司已主动自查并采取整改措施,要求公司充分重视信息披露工作,认真学习公司债券相关法律法规,理顺债券相关信息披露流程和渠道,完善内部管控机制,切实提升规范运作水平。公司针对《监管函》涉及的问题,董事长、董事会秘书主动向深交所汇报了监管函提到的关于媒体报道中的表述内容,并对该业务现情况进行了详细说明,承诺认真整改,严格遵循信息披露的公开、公平、公正的原则,向所有投资者真实、准确、完整、及时地履行信息披露义务

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格林美,认为本次行政监管措施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。

5.11.2
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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	17,507.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,845.84
5	应收申购款	61,029.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	80,382.76

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 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	002366	台海核电	1,645,190.00	1.19	重大事项

5.11.7 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	300730	科创信息	34,112.55	0.02	重大事项
2	300664	鹏鹞环保	32,323.20	0.02	新股锁定

5.11.8 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	鹏华环保分级	鹏华环保A	鹏华环保B
报告期期初基金份额总额	117,425,411.04	4,595,324.00	4,595,324.00
报告期期间基金总申购份额	21,601,850.34	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	27,227,762.29	-	-
报告期期间基金份额分类变动份额(份额减少以"-"填列)	2,978,910.42	-255,437.00	-255,437.00
报告期期末基金份额总额	114,778,409.51	4,339,887.00	4,339,887.00

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末申购、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)《鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》;
(二)《鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金托管协议》;
(三)《鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金2017年度第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
北京市西城区阜市口大街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
2018年1月22日

鹏华中证酒指数分级证券投资基金

2017 第四季度 报告

2017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:2018年1月22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2018年1月17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10月1日起至12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
交易代码	160632
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	2015年4月29日
报告期末基金份额总额	236,465,155.50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。 本基金力争鹏华酒份额净值增长率与预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
下属分级基金的基金简称	鹏华酒分级	鹏华酒A	鹏华酒B
下属分级基金场内简称	酒分级	酒A	酒B
下属分级基金的交易代码	160632	150229	150230
报告期末下属分级基金的份额总额	203,239,874.50份	16,612,640.00份	16,612,641.00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(2017年10月1日-2017年12月31日)
1.本期已实现收益	46,737,307.14
2.本期利润	39,928,025.95
3.加权平均基金份额本期利润	0.1501
4.期末基金资产净值	312,084,765.86
5.期末基金份额净值	1.320

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。

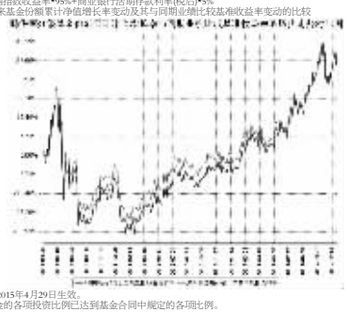
3.2 基金净值表现

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	9.93%	1.59%	10.11%	1.58%	-0.18%	0.01%

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。
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	2015年4月28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,2017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或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1.320,累计净值1.381。本报告期基金份额净值增长率为9.93%。本报告期,基金年化跟踪误差2.08%,日均跟踪偏离0.07%。

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	295,639,733.25	92.90
	其中:股票	295,639,733.25	92.90
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	19,335,577.71	6.08
8	其他资产	3,270,920.69	1.03
9	合计	318,246,231.65	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	295,014,703.55	94.53
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	32,323.20	0.00
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	295,014,703.55	94.53

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	采矿业	-	-
C	制造业	524,507.99	0.17
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输,仓储和邮政业	17,942.76	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输,软件和信息技术服务业	34,112.55	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	32,323.20	0.01
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	625,029.70	0.20

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	000858	五粮液	401,321	32,057,521.48	10.27
2	600519	贵州茅台	42,768	29,830,252.32	9.56
3	002304	洋河股份	252,793	29,071,195.00	9.32
4	000568	泸州老窖	437,275	28,860,150.00	9.25
5	600779	水井坊	356,800	16,698,240.00	5.35
6	600809	山西汾酒	271,006	15,444,631.94	4.95
7	603589	口子窖	313,007	14,413,972.35	4.62
8	600600	青岛啤酒	363,057	14,279,031.81	4.58
9	600702	舍得酒业	281,553	13,137,262.98	4.21
10	000729	燕京啤酒	1,470,400	9,910,496.00	3.18

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	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.09
2	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.02
3	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.01
4	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.01
5	300730	科创信息	821	34,112.55	0.01

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:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

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,降低申赎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
本报告投资的前十名证券之一四川沱牌舍得酒业股份有限公司(以下简称"沱牌舍得")于2017年7月21日披露了《关于截近五年被证券监管部门和交易所采取处罚或监管措施的情况及相应的整改措施的公告》(以下简称《公告》),《公告》