

# 鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资 基金 2015 年年度报告

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：招商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自 2015 年 5 月 18 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	43
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
8.6 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.....	51
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	51

8.8	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贵金属投资明细	51
8.9	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	51
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
8.12	投资组合报告附注	51
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>52</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
9.2	期末上市基金前十名持有人	53
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	54
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>54</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>55</b>
11.1	基金份额持有人大会决议	55
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	55
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
11.4	基金投资策略的改变	55
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	55
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
11.8	其他重大事件	57
<b>§12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>75</b>
12.1	备查文件目录	75
12.2	存放地点	75
12.3	查阅方式	75

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金		
基金简称	鹏华一带一路分级		
场内简称	带路分级		
基金主代码	160638		
交易代码	160638		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 5 月 18 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		
报告期末基金份额总额	745,938,031.00 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015-5-25		
下属分级基金的基金简称	带路分级	带路 A	带路 B
下属分级基金的场内简称	带路分级	带路 A	带路 B
下属分级基金的交易代码	160638	150273	150274
报告期末下属分级基金份额总额	622,267,473.00 份	61,835,279.00 份	61,835,279.00 份

### 2.2 基金产品说明

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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>本基金力争鹏华一带一路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。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>(1) 股票投资组合的构建</p>

	<p>本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p>(2) 股票投资组合的调整</p> <p>本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况，对其进行适时调整，以保证鹏华一带一路份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。</p> <p>1) 定期调整</p> <p>根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。</p> <p>2) 不定期调整</p> <p>根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整；</p> <p>根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；</p> <p>根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金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。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金可以根据流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。</p> <p>3、衍生品投资策略</p> <p>本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。</p> <p>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。</p> <p>基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。</p> <p>本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型</p>
--	--

	<p>及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p> <p>4、资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p>		
业绩比较基准	中证一带一路主题指数收益率×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。		
下属分级基金的风险收益特征	<p>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。</p>	<p>鹏华带路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。</p>	<p>鹏华带路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。</p>

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	张燕
	联系电话	0755-82825720	0755-83199084
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006788999	95555
传真		0755-82021126	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层	深圳深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层	深圳深南大道7088号招商银行大厦

	层	
邮政编码	518048	518040
法定代表人	何如	李建红

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦招商银行股份有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年 5 月 18 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-956,920,766.86
本期利润	-1,220,649,340.92
加权平均基金份额本期利润	-0.9736
本期加权平均净值利润率	-102.26%
本期基金份额净值增长率	-40.43%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末
期末可供分配利润	-470,320,276.24
期末可供分配基金份额利润	-0.6305
期末基金资产净值	693,010,425.85
期末基金份额净值	0.929
3.1.3 累计期末指标	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-40.43%

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) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

(4) 本基金基金合同于 2015 年 5 月 18 日生效，至 2015 年 12 月 31 日未满一年，故 2015 年的数据和指标为非完整会计年度数据。

## 3.2 基金净值表现

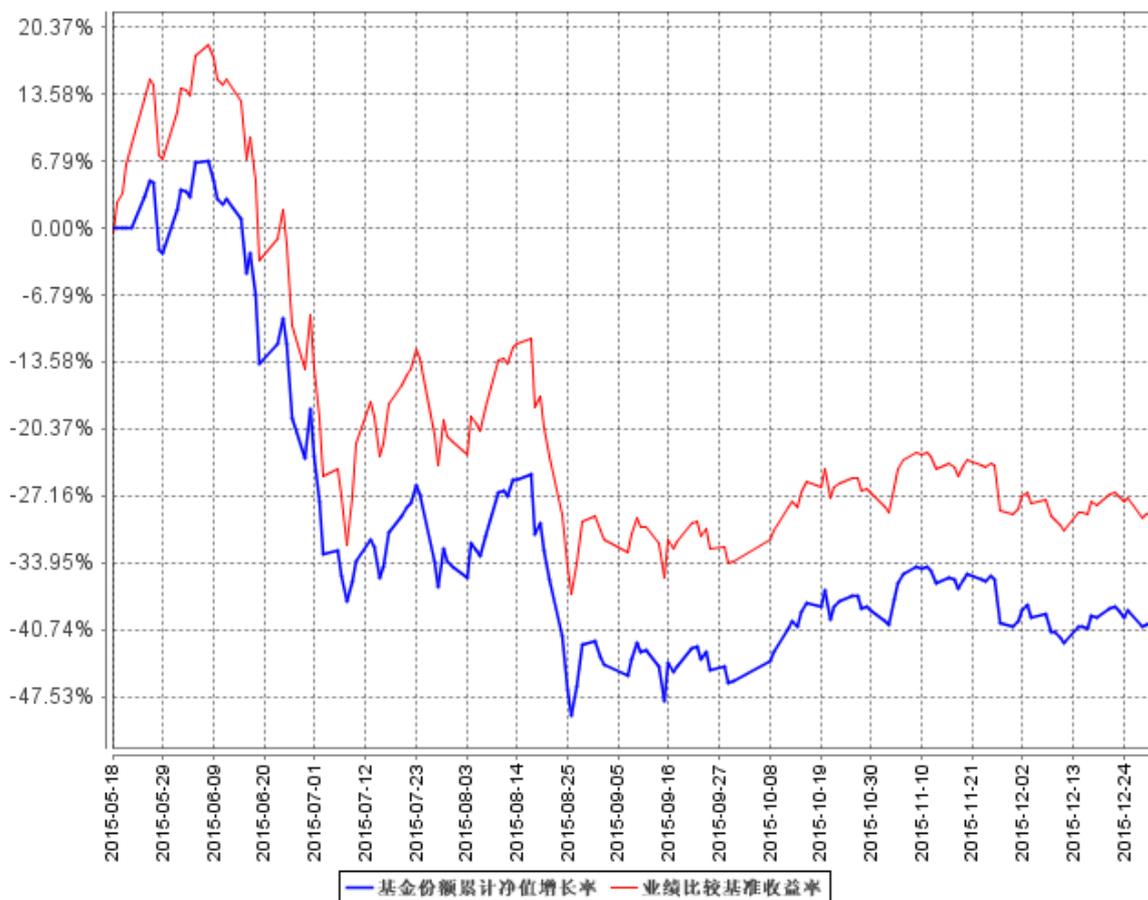
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	10.07%	1.93%	6.65%	1.67%	3.42%	0.26%
过去六个月	-27.08%	3.19%	-22.48%	3.09%	-4.60%	0.10%
自基金合同生效起至今	-40.43%	3.24%	-29.29%	3.19%	-11.14%	0.05%

注：业绩比较基准=中证一带一路主题指数收益率\*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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

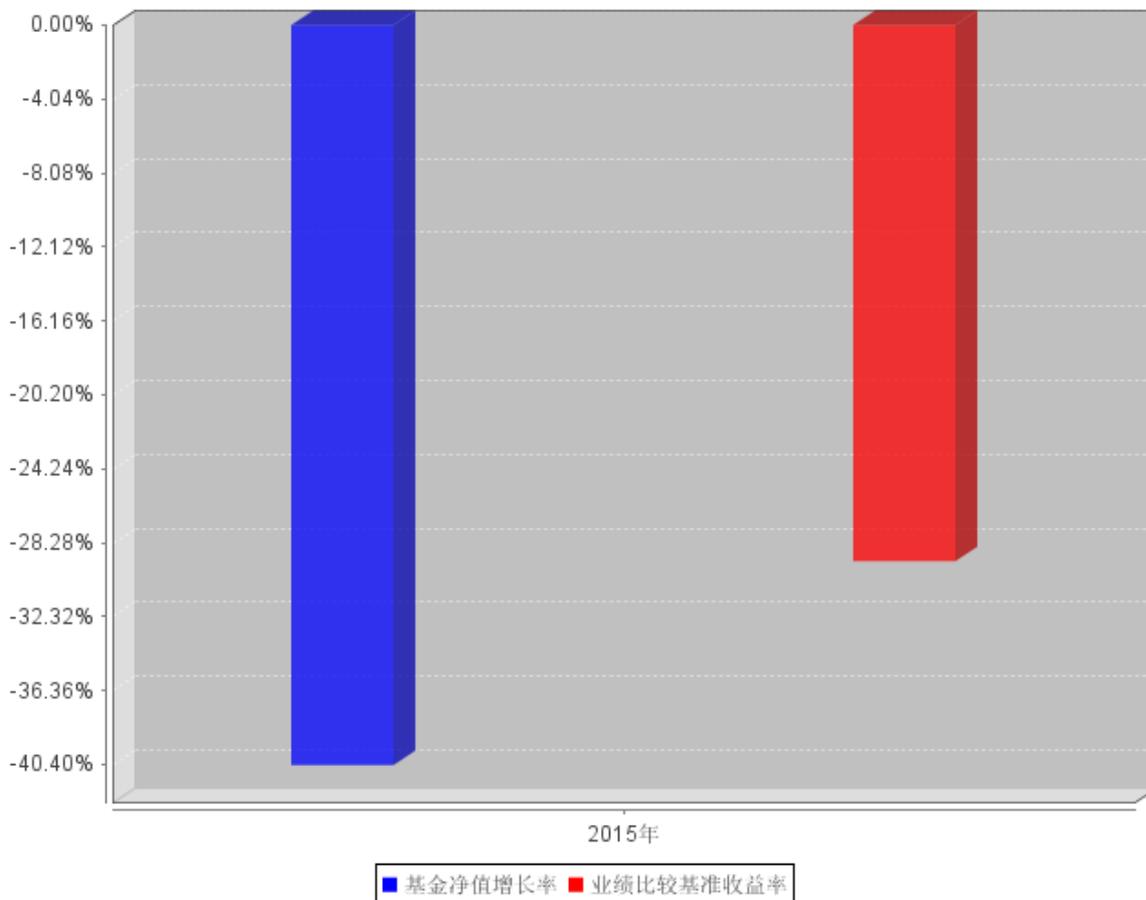


注：1、本基金基金合同于 2015 年 5 月 18 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。

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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：根据本基金基金合同约定，在存续期内，本基金（包括鹏华带路份额、鹏华带路 A 份额、鹏华带路 B 份额）不进行收益分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限

公司组成，公司性质为中外合资企业。公司原注册资本 8,000 万元人民币，后于 2001 年 9 月完成增资扩股，增至 15,000 万元人民币。截止本报告期末，公司管理 88 只开放式基金和 10 只社保组合，经过 17 年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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 18 日	-	6	焦文龙先生，国籍中国，经济学硕士，6 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资深量化研究员，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月起兼任鹏华新丝路分级基金、鹏华钢铁分级基金基金经理，2015年11月起兼任鹏华创业板分级基金基金经理。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。本基金为本期新成立基金。
--	--	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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，本基金运作合法合规，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管

理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用产品投资管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，集中交易室应严格启用恒生交易系统中的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员

进行分析；3、监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析；《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

#### 4.3.2 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。同时，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析，未发现存在违反公平交易原则的现象。

#### 4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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，跟踪指数收益，力争将基金跟踪误差控制在合理范围内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末，本基金份额净值为 0.9290 元，累计净值 0.5960 元。本报告期基金份额净值增长率为-40.43%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年，伴随中国经济持续低迷，实体经济投资回报率持续下降，但证券市场在改革预期以及充裕流动性的推动下，走势波澜壮阔。

展望未来，改革进入深水区，难度增大，去产能本身也是一个痛苦的过程；但改革是必由之路，随着供给侧改革的推进，经济有望逐步筑底。映射到证券市场，改革措施的落地会逐步修正投资者预期，实体经济的分化会导致结构化的行情，2016 年未必可以看到整体市场大幅趋势性上涨，但结构性机会将会明显增加。

本基金作为被动管理的指数基金，在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下，将继续秉

承指数化投资管理策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，进一步降低基金的跟踪误差，力争投资回报与业绩基准保持一致。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人继续完善内部控制、提升风险管理水平，着重开展了以下各项工作：

##### 1、继续完善内部控制体系

公司不断更新完善业务流程和运营风险数据库，通过标准化业务流程将业务操作落实到岗，明确业务流程与控制活动的关联关系，确定关键控制活动，以及各个业务操作所使用的相关文档或表单，并将业务操作与法律法规的相关法条建立关联，将控制活动与风险建立关联，将法律法规要求与信息披露报备规则建立关联。

##### 2、继续优化内部控制措施

报告期内，公司继续完善内部控制措施，制定、颁布和更新了一系列公司基本管理制度，通过信息技术手段陆续实现了部分标准化操作流程手册的系统化，并不断优化。

##### 3、持续改进投资监控的方法与手段，保证基金投资业务的合法合规性

报告期内，在投资日常合规监控工作方面，公司根据产品特点进一步完善了投资监控系统以提升投资监控效率；在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上，公司加强了内幕交易风险的检查和防范，明确了内幕交易防范要求，多次开展有关内幕交易的培训，进一步强化全体投研人员对内幕交易行为和结果的认识。

##### 4、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

报告期内，在基金募集和持续营销活动中，公司严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作，本报告期内没有出现主动违规行为。

##### 5、开展以风险为导向的内部稽核

报告期内，监察稽核部开展了对基金投资管理、市场营销管理、财务费用管理和公司日常运作的定期监察稽核与专项监察稽核。监察稽核人员开展了以风险为导向的内部稽核，通过稽核发现，提高了公司标准化操作流程手册的执行效力，优化了标准化操作流程手册，更新了风险控制矩阵。报告期内，公司没有发生重大风险事件。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

### (1) 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

### (2) 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

#### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、本公司现没有进行任何定价服务的签约。

## 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、根据本基金基金合同约定，在存续期内，本基金（包括鹏华带路份额、鹏华带路 A 份额、鹏华带路 B 份额）不进行收益分配。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

## 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第 20585 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华中证一带一路指数分级证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的鹏华中证一带一路指数分级证券投资基金(以下简称“鹏华一带一路分级”)的财务报表,包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 5 月 18 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是鹏华一带一路分级的基金管理人鹏华基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称

	<p>“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表, 并使其实现公允反映;</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为, 上述鹏华一带一路分级的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 公允反映了鹏华一带一路分级 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 5 月 18 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	单峰   陈熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国 上海市
审计报告日期	2016 年 3 月 23 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金

报告截止日: 2015 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
-----	-----	-------------------------

<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	34,720,460.30
结算备付金		152,271.77
存出保证金		1,250,829.65
交易性金融资产	7.4.7.2	656,658,805.29
其中：股票投资		656,658,805.29
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		2,548,415.08
应收利息	7.4.7.5	9,076.88
应收股利		-
应收申购款		155,647.62
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		695,495,506.59
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		1,218,531.68
应付管理人报酬		606,001.32
应付托管费		133,320.28
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	207,626.81
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	319,600.65
负债合计		2,485,080.74
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	1,163,330,702.09
未分配利润	7.4.7.10	-470,320,276.24
所有者权益合计		693,010,425.85
负债和所有者权益总计		695,495,506.59

注：(1)报告截止日 2015 年 12 月 31 日，鹏华带路分级份额净值 0.929 元，鹏华带路 A 份额净值 1.024 元，鹏华带路 B 份额净值 0.834 元；基金份额总额 745,938,031.00 份，其中鹏华带路分级份额 622,267,473.00 份，鹏华带路 A 份额 61,835,279.00 份，鹏华带路 B 份额 61,835,279.00 份。

(2)本基金基金合同于 2015 年 5 月 18 日生效，无上年度末数据。

## 7.2 利润表

会计主体：鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 5 月 18 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 5 月 18 日(基金合同生效 日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-1,203,019,128.77
1.利息收入		981,886.61
其中：存款利息收入	7.4.7.11	644,200.00
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		337,686.61
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-942,502,585.00
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-954,827,507.28
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	12,324,922.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-263,728,574.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,230,143.68
<b>减：二、费用</b>		17,630,212.15
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	7,407,949.57
2.托管费	7.4.10.2.2	1,629,748.84
3.销售服务费		-
4.交易费用	7.4.7.18	8,086,098.82
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用	7.4.7.19	506,414.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,220,649,340.92

减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-1,220,649,340.92</b>

注：(1) 报告实际编制期间为 2015 年 5 月 18 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日。

(2) 本基金基金合同于 2015 年 5 月 18 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 5 月 18 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 18 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	606,402,064.93	-	606,402,064.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,220,649,340.92	-1,220,649,340.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	556,928,637.16	750,329,064.68	1,307,257,701.84
其中：1. 基金申购款	3,106,016,868.87	-14,694,418.67	3,091,322,450.20
2. 基金赎回款	-2,549,088,231.71	765,023,483.35	-1,784,064,748.36
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,163,330,702.09	-470,320,276.24	693,010,425.85

注：(1) 报告实际编制期间为 2015 年 5 月 18 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日。

(2) 本基金基金合同于 2015 年 5 月 18 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
邓召明

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
高鹏

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
郝文高

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 769 号《关于准予鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金注册的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 606,374,145.94 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 484 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 18 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 606,402,064.93 份基金份额,其中认购资金利息折合 27,918.99 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》并报中国证监会备案,本基金的基金份额包括鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“鹏华一带一路份额”)、鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金之 A 份额(以下简称“鹏华带路 A 份额”)、鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金之 B 份额(以下简称“鹏华带路 B 份额”)。根据对基金财产及收益分配的不同安排,本基金的基金份额具有不同的风险收益特征。鹏华一带一路份额为可以申购、赎回但不能上市交易的基金份额,具有与标的指数相似的风险收益特征。鹏华带路 A 份额与鹏华带路 B 份额为可以上市交易但不能申购、赎回的基金份额,其中鹏华带路 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风险收益特征,鹏华带路 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风险收益特征。鹏华带路 A 份额与鹏华带路 B 份额的配比始终保持 1:1 的比率不变。本基金的基金份额初始公开发售结束后,场外认购的全部份额将确认为鹏华一带一路份额;场内认购的份额将按照 1:1 的比例确认为鹏华带路 A 份额与鹏华带路 B 份额。本基金基金合同生效后,鹏华一带一路份额与鹏华带路 A 份额、鹏华带路 B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换,包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。基金份额的分拆,指基金份额持有人将其持有的鹏华一带一路份额按照 2 份场内鹏华一带一路份额对应 1 份鹏华带路 A 份额与 1 份鹏华带路 B 份额的比例进行转换的行为;基金份额的合并,指基金份额持有人将其持有的鹏华带路 A 份额与鹏华带路 B 份额按照 1 份鹏华带路 A 份额与 1 份鹏华带路 B 份额对应 2 份场内鹏华一带一路份额的比例进行转换的行为。

基金份额的净值按如下原则计算:鹏华一带一路份额的基金份额净值为净值计算日的基金资

产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为鹏华一带一路份额、鹏华带路 A 份额、鹏华带路 B 份额的份额数之和。鹏华带路 A 份额的基金份额净值为鹏华带路 A 份额的本金及约定应得收益之和。每 2 份鹏华一带一路份额所对应的基金资产净值等于 1 份鹏华带路 A 份额与 1 份鹏华带路 B 份额所对应的基金资产净值之和。

本基金定期进行份额折算。在鹏华带路 A 份额、鹏华一带一路份额存续期内的每个会计年度 9 月第一个工作日，本基金将进行基金的定期份额折算。在基金份额折算前与折算后，鹏华带路 A 份额与鹏华带路 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于鹏华带路 A 份额的约定应得收益，即鹏华带路 A 份额每个会计年度 8 月 31 日基金份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内鹏华一带一路份额分配给鹏华带路 A 份额持有人。鹏华一带一路份额持有人持有的每 2 份鹏华一带一路份额将按 1 份鹏华带路 A 份额获得新增鹏华一带一路份额的分配。持有场外鹏华一带一路份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外鹏华一带一路份额的分配；持有场内鹏华一带一路份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内鹏华一带一路份额的分配。经过上述份额折算，鹏华带路 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，鹏华一带一路份额的基金份额净值将相应调整。

除定期份额折算外，本基金还将在鹏华一带一路份额的基金份额净值达到 1.500 元时或鹏华带路 B 份额的基金份额参考净值跌至 0.250 元时进行不定期份额折算。当达到不定期折算条件时，本基金将分别对鹏华一带一路份额、鹏华带路 A 份额、鹏华带路 B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保鹏华带路 A 份额与鹏华带路 B 份额的比例为 1:1，份额折算后鹏华一带一路份额的基金份额净值、鹏华带路 A 份额与鹏华带路 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2015]第 213 号文审核同意，本基金鹏华带路 A 份额 146,134,555.00 份基金份额和鹏华带路 B 份额 146,134,555.00 份基金份额于 2015 年 5 月 25 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的鹏华一带一路份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为鹏华带路 A 份额和鹏华带路 B 份额即可上市流通；对于托管在场外的鹏华一带一路份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深交所场内后分拆为鹏华带路 A 份额和鹏华带路 B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股(含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票)、债券、股指期货、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于股票部分的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份

股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证一带一路主题指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 5 月 18 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 5 月 18 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 5 月 18 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币，除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### （1）金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具（主要为权证投资）分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产

在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1) 金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

(2) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

(3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动作为公允价值变动损益计入当期损益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利以及处置时产生的处置损益计入当期损益。

(4) 金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(4.1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(4.2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(4.3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

(5) 金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

(6) 当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累

计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1. 在存续期内,本基金(包括鹏华带路份额、鹏华带路 A 份额、鹏华带路 B 份额)不进行收益分配。

2. 法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 本基金根据中国证券投资基金业协会《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），对于交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），对于交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

本基金基金合同于 2015 年 5 月 18 日生效，截至本报告期末不满一年，无上年度可比期间数据。

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	34,720,460.30
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	34,720,460.30

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	920,387,379.35	656,658,805.29	-263,728,574.06

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	920,387,379.35	656,658,805.29	-263,728,574.06

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应收活期存款利息	8,382.45
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	75.35
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	619.08
合计	9,076.88

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

注：无。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	207,626.81
银行间市场应付交易费用	-
合计	207,626.81

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,600.65
预提费用	265,000.00
指数使用费	50,000.00
合计	319,600.65

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 18 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	606,402,064.93	606,402,064.93
本期申购	2,910,151,133.00	2,910,151,133.00
本期赎回(以“-”号填列)	-630,434,695.53	-630,434,695.53
2015 年 7 月 9 日 基金拆分/份 额折算前	2,886,118,502.40	2,886,118,502.40
基金拆分/份额折算变动份额	-1,035,411,949.25	-
本期申购	125,592,206.59	195,865,735.87
本期赎回(以“-”号填列)	-1,230,360,728.74	-1,918,653,536.18
本期末	745,938,031.00	1,163,330,702.09

注：1. 申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2015 年 5 月 8 日至 2015 年 5 月 12 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 606,374,145.94 元。根据《鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 27,918.99 元在本基金成立后，折算为 27,918.99 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，当鹏华带路 B 份额的基金份额参考净值跌至 0.250 元时，本基金将进行不定期份额折算。于 2015 年 7 月 8 日，本基金鹏华带路 B 份额的基金份额参考净值为 0.2350 元，达到基金合同规定的不定期份额折算阈值。根据《鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告》，本基金的基金管理人确定 2015 年 7 月 9 日为份额折算基准日。2015 年 7 月 13 日，本基金管理人对外披露了折算结果，本基金的申购（含定期定额投资）、赎回、转托管（包括场外转托管和跨系统转托管）和配对转换业务及鹏华带路 A、鹏华带路 B 份额的二级市场交易已于当日恢复。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-956,920,766.86	-263,728,574.06	-1,220,649,340.92
本期基金份额交易产生的变动数	489,545,604.91	260,783,459.77	750,329,064.68
其中：基金申购款	-72,550,291.53	57,855,872.86	-14,694,418.67
基金赎回款	562,095,896.44	202,927,586.91	765,023,483.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-467,375,161.95	-2,945,114.29	-470,320,276.24

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 18 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	554,423.16
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	68,296.01
其他	21,480.83
合计	644,200.00

注：其他为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 18 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,070,354,304.54

减：卖出股票成本总额	3,025,181,811.82
买卖股票差价收入	-954,827,507.28

#### 7.4.7.13 债券投资收益

注：无。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

注：无。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年5月18日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	12,324,922.28
基金投资产生的股利收益	-
合计	12,324,922.28

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年5月18日(基金合同生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-263,728,574.06
——股票投资	-263,728,574.06
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-263,728,574.06

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 18 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,099,757.59
转换费收入	130,386.09
合计	2,230,143.68

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 18 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	8,086,098.82
银行间市场交易费用	-
合计	8,086,098.82

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 18 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00
信息披露费	165,000.00
其他	400.00
上市年费	70,000.00
指数使用费	160,671.08
银行汇划费用	10,343.84
合计	506,414.92

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

无。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

鹏华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
意大利欧利盛资本资产管理股份公司 （Eurizon Capital SGR S.p.A.）	基金管理人的股东
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
鹏华资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注：1、本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金基金合同于 2015 年 5 月 18 日生效，截至本报告期末不满一年，无上年度可比期间数据。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 18 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,407,949.57
其中：支付销售机构的客户维护费	2,841,663.93

注：(1)支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为 1.00%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.00%÷当年天数。

(2) 根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年5月18日(基金合同生效日)至2015年12月 31日	
	当期发生的基金应支付的托管费	1,629,748.84

注：支付基金托管人招商银行股份有限公司的托管费年费率为 0.22%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.22%÷当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期管理人未投资、持有本基金。本基金合同生效日起至本报告期末未满一年，故无上年度可比期间数据。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2015年5月18日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	34,720,460.30	554,423.16

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末参与关联方承销的证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总 额
601018	宁波 港	2015 年 8 月 4 日	重大 事项	7.63	2016 年 2 月 22 日	7.34	3,103,864	32,289,240.80	23,682,482.32
300011	鼎汉 技术	2015 年 12 月 31 日	重大 事项	29.80	2016 年 1 月 22 日	26.82	144,208	5,588,392.91	4,297,398.40
002207	准油 股份	2015 年 12 月 16 日	重大 事项	21.42	-	-	104,800	3,255,954.00	2,244,816.00
000065	北方 国际	2015 年 10 月 21 日	重大 事项	30.53	2016 年 3 月 15 日	-	67,900	2,918,907.47	2,072,987.00
300351	永贵 电器	2015 年 10 月 19 日	重大 事项	31.30	2016 年 2 月 18 日	29.80	62,940	2,753,109.18	1,970,022.00

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协

调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在承受的范围之内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品

种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金及部分应收申购款，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	34,720,460.30	-	-	-	34,720,460.30
结算备付金	152,271.77	-	-	-	152,271.77
存出保证金	1,250,829.65	-	-	-	1,250,829.65
交易性金融资产	-	-	-	656,658,805.29	656,658,805.29
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	2,548,415.08	2,548,415.08
应收利息	-	-	-	9,076.88	9,076.88
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	155,647.62	155,647.62
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	36,123,561.72	-	-	659,371,944.87	695,495,506.59
负债					
短期借款					
交易性金融负债					
衍生金融负债					
卖出回购金融资产款					
应付证券清算款					
应付赎回款				1,218,531.68	1,218,531.68
应付管理人报酬				606,001.32	606,001.32
应付托管费				133,320.28	133,320.28
应付销售服务费					
应付交易费用				207,626.81	207,626.81
应交税费					
应付利息					
应付利润					
其他负债				319,600.65	319,600.65
负债总计				2,485,080.74	2,485,080.74
利率敏感度缺口	36,123,561.72			656,886,864.13	693,010,425.85

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票部分的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及

其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	656,658,805.29	94.75
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	656,658,805.29	94.75

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	37,217,289.61
	业绩比较基准下降 5%	-37,217,289.61

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 622, 391, 099. 57 元, 属于第二层次的余额为 34, 267, 705. 72 元, 无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	656, 658, 805. 29	94. 42
	其中: 股票	656, 658, 805. 29	94. 42
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	34, 872, 732. 07	5. 01

7	其他各项资产	3,963,969.23	0.57
8	合计	695,495,506.59	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	70,907,146.07	10.23
C	制造业	308,747,843.43	44.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	152,805,489.87	22.05
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	110,178,267.24	15.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,292,308.68	1.92
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	727,750.00	0.11
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	656,658,805.29	94.75

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 8.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601018	宁波港	3,103,864	23,682,482.32	3.42
2	000063	中兴通讯	1,119,228	20,851,217.64	3.01
3	600028	中国石化	4,010,920	19,894,163.20	2.87
4	601668	中国建筑	3,121,700	19,791,578.00	2.86
5	601857	中国石油	2,355,000	19,664,250.00	2.84
6	002202	金风科技	855,702	19,501,448.58	2.81
7	601766	中国中车	1,486,000	19,095,100.00	2.76
8	601186	中国铁建	1,411,963	19,033,261.24	2.75
9	601390	中国中铁	1,741,768	19,020,106.56	2.74
10	601989	中国重工	1,995,509	18,757,784.60	2.71
11	601727	上海电气	1,615,944	18,647,993.76	2.69
12	601669	中国电建	2,256,338	18,118,394.14	2.61
13	600089	特变电工	1,421,281	16,728,477.37	2.41
14	601618	中国中冶	2,584,700	15,559,894.00	2.25
15	600118	中国卫星	323,300	13,753,182.00	1.98
16	600031	三一重工	2,082,345	13,701,830.10	1.98
17	600406	国电南瑞	796,901	13,292,308.68	1.92
18	600150	中国船舶	376,850	13,125,685.50	1.89
19	000157	中联重科	2,402,133	12,851,411.55	1.85
20	601866	中海集运	1,734,951	12,214,055.04	1.76
21	600068	葛洲坝	1,510,735	11,889,484.45	1.72
22	600018	上港集团	1,774,000	11,495,520.00	1.66
23	600256	广汇能源	1,713,019	11,425,836.73	1.65
24	601106	中国一重	1,430,046	11,397,466.62	1.64
25	601800	中国交建	835,100	11,198,691.00	1.62
26	600583	海油工程	1,208,850	10,819,207.50	1.56
27	000425	徐工机械	2,324,200	9,877,850.00	1.43
28	600522	中天科技	399,800	9,155,420.00	1.32
29	600820	隧道股份	859,609	9,146,239.76	1.32
30	600875	东方电气	655,200	8,930,376.00	1.29
31	601872	招商轮船	1,159,100	8,218,019.00	1.19
32	300208	恒顺众昇	335,350	8,149,005.00	1.18
33	601179	中国西电	1,121,200	7,635,372.00	1.10

34	601117	中国化学	1,079,000	7,434,310.00	1.07
35	600312	平高电气	373,200	7,277,400.00	1.05
36	600026	中海发展	748,100	6,912,444.00	1.00
37	600017	日照港	1,009,100	6,599,514.00	0.95
38	000400	许继电气	330,824	6,427,910.32	0.93
39	300001	特锐德	219,200	6,356,800.00	0.92
40	002266	浙富控股	757,390	6,165,154.60	0.89
41	600528	中铁二局	398,953	5,716,996.49	0.82
42	600320	振华重工	908,300	5,422,551.00	0.78
43	000777	中核科技	167,800	5,267,242.00	0.76
44	600717	天津港	457,896	5,160,487.92	0.74
45	600317	营口港	1,061,831	5,043,697.25	0.73
46	601808	中海油服	323,832	5,025,872.64	0.73
47	600495	晋西车轴	462,520	4,842,584.40	0.70
48	600428	中远航运	462,200	4,742,172.00	0.68
49	600580	卧龙电气	303,700	4,683,054.00	0.68
50	002092	中泰化学	532,132	4,682,761.60	0.68
51	600125	铁龙物流	499,700	4,592,243.00	0.66
52	600970	中材国际	383,700	4,585,215.00	0.66
53	601880	大连港	735,700	4,384,772.00	0.63
54	300011	鼎汉技术	144,208	4,297,398.40	0.62
55	002051	中工国际	169,231	4,286,621.23	0.62
56	000088	盐田港	424,800	3,661,776.00	0.53
57	603308	应流股份	109,400	3,426,408.00	0.49
58	600545	新疆城建	295,700	3,273,399.00	0.47
59	601002	晋亿实业	260,100	2,998,953.00	0.43
60	603111	康尼机电	96,700	2,780,125.00	0.40
61	000877	天山股份	336,876	2,705,114.28	0.39
62	600425	青松建化	452,400	2,642,016.00	0.38
63	002531	天顺风能	180,100	2,476,375.00	0.36
64	002524	光正集团	220,200	2,334,120.00	0.34
65	600798	宁波海运	338,207	2,313,335.88	0.33
66	002207	准油股份	104,800	2,244,816.00	0.32
67	000065	北方国际	67,900	2,072,987.00	0.30
68	002307	北新路桥	182,900	2,063,112.00	0.30
69	300351	永贵电器	62,940	1,970,022.00	0.28
70	000905	厦门港务	145,200	1,929,708.00	0.28
71	601008	连云港	277,600	1,876,576.00	0.27
72	000928	中钢国际	105,500	1,866,295.00	0.27

73	002554	惠博普	141,000	1,833,000.00	0.26
74	600190	锦州港	292,000	1,676,080.00	0.24
75	600279	重庆港九	101,100	1,646,919.00	0.24
76	000852	石化机械	75,500	1,612,680.00	0.23
77	002606	大连电瓷	89,300	1,607,400.00	0.23
78	300103	达刚路机	57,929	1,540,332.11	0.22
79	002302	西部建设	84,700	1,509,354.00	0.22
80	600368	五洲交通	228,050	1,498,288.50	0.22
81	000022	深赤湾 A	76,300	1,472,590.00	0.21
82	603969	银龙股份	65,700	1,311,372.00	0.19
83	000582	北部湾港	46,983	1,057,587.33	0.15
84	002738	中矿资源	20,500	727,750.00	0.11

### 8.3.2 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所有股票投资明细

注：无。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601766	中国中车	299,525,088.48	43.22
2	601390	中国中铁	159,713,136.41	23.05
3	601989	中国重工	129,620,098.45	18.70
4	601186	中国铁建	127,249,237.77	18.36
5	601857	中国石油	124,949,129.51	18.03
6	601668	中国建筑	124,144,572.65	17.91
7	601669	中国电建	120,201,976.25	17.34
8	600028	中国石化	114,400,717.51	16.51
9	000063	中兴通讯	113,809,079.45	16.42
10	601727	上海电气	108,092,153.71	15.60
11	600089	特变电工	99,405,842.53	14.34
12	600031	三一重工	96,203,258.88	13.88
13	601618	中国中冶	96,029,543.78	13.86
14	601018	宁波港	92,977,211.89	13.42

15	600150	中国船舶	89,948,814.51	12.98
16	601106	中国一重	87,402,999.34	12.61
17	600406	国电南瑞	82,729,066.44	11.94
18	002202	金风科技	82,108,993.03	11.85
19	000157	中联重科	81,201,451.29	11.72
20	600068	葛洲坝	74,989,089.02	10.82
21	600256	广汇能源	72,405,047.48	10.45
22	600875	东方电气	68,866,993.84	9.94
23	601800	中国交建	67,780,413.73	9.78
24	600583	海油工程	66,361,606.08	9.58
25	601866	中海集运	64,164,846.75	9.26
26	600018	上港集团	58,971,213.91	8.51
27	600820	隧道股份	58,102,384.38	8.38
28	601179	中国西电	50,968,050.92	7.35
29	601117	中国化学	49,440,274.51	7.13
30	000425	徐工机械	43,989,670.55	6.35
31	000400	许继电气	41,078,682.32	5.93
32	600320	振华重工	39,141,171.33	5.65
33	601872	招商轮船	38,379,630.63	5.54
34	002266	浙富控股	38,367,144.24	5.54
35	600026	中海发展	37,677,567.00	5.44
36	300208	恒顺众昇	36,775,537.25	5.31
37	600522	中天科技	36,768,691.00	5.31
38	600528	中铁二局	35,024,999.89	5.05
39	600717	天津港	34,204,566.18	4.94
40	601808	中海油服	33,834,474.84	4.88
41	002051	中工国际	30,031,728.83	4.33
42	002092	中泰化学	29,665,966.34	4.28
43	600312	平高电气	29,250,105.50	4.22
44	600317	营口港	28,570,602.58	4.12
45	000777	中核科技	28,017,694.02	4.04
46	600017	日照港	27,685,510.40	3.99
47	600125	铁龙物流	27,383,776.53	3.95
48	300001	特锐德	26,878,592.76	3.88
49	300011	鼎汉技术	26,055,026.25	3.76
50	600970	中材国际	25,766,317.94	3.72

51	600495	晋西车轴	24,381,901.92	3.52
52	600580	卧龙电气	22,582,985.24	3.26
53	601002	晋亿实业	21,443,225.95	3.09
54	000088	盐田港	21,298,948.79	3.07
55	600545	新疆城建	21,164,565.80	3.05
56	601880	大连港	20,668,611.67	2.98
57	600428	中远航运	20,087,772.50	2.90
58	000877	天山股份	18,011,021.19	2.60
59	600798	宁波海运	14,459,400.02	2.09
60	600118	中国卫星	14,339,913.38	2.07

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601766	中国中车	164,886,797.36	23.79
2	601390	中国中铁	97,164,722.04	14.02
3	601857	中国石油	94,346,136.65	13.61
4	600028	中国石化	76,473,895.88	11.04
5	601186	中国铁建	71,876,428.22	10.37
6	601668	中国建筑	71,582,634.46	10.33
7	601989	中国重工	69,880,259.62	10.08
8	000063	中兴通讯	60,192,063.81	8.69
9	600089	特变电工	56,385,065.70	8.14
10	601669	中国电建	55,797,670.63	8.05
11	601618	中国中冶	51,253,837.66	7.40
12	000157	中联重科	44,727,264.89	6.45
13	601727	上海电气	43,741,926.72	6.31
14	002202	金风科技	43,537,931.37	6.28
15	600150	中国船舶	42,938,764.97	6.20
16	600031	三一重工	42,729,542.67	6.17
17	600406	国电南瑞	40,713,771.11	5.87
18	601800	中国交建	40,491,438.98	5.84
19	600256	广汇能源	37,689,412.11	5.44
20	600583	海油工程	37,666,275.75	5.44
21	601106	中国一重	37,185,144.22	5.37

22	600068	葛洲坝	37,165,139.25	5.36
23	601018	宁波港	36,305,644.62	5.24
24	601866	中海集运	33,876,196.12	4.89
25	600018	上港集团	32,745,027.61	4.73
26	600875	东方电气	27,891,600.34	4.02
27	600820	隧道股份	27,353,649.58	3.95
28	000425	徐工机械	26,377,029.22	3.81
29	601179	中国西电	25,995,374.50	3.75
30	601117	中国化学	25,954,209.76	3.75
31	601872	招商轮船	23,596,361.68	3.40
32	600320	振华重工	22,976,039.99	3.32
33	600026	中海发展	21,836,149.10	3.15
34	000400	许继电气	20,114,136.69	2.90
35	300208	恒顺众昇	19,108,589.20	2.76
36	600522	中天科技	19,023,683.00	2.75
37	002266	浙富控股	18,563,544.42	2.68
38	601808	中海油服	18,141,768.78	2.62
39	600017	日照港	17,412,002.00	2.51
40	600317	营口港	17,168,326.93	2.48
41	600717	天津港	17,055,943.71	2.46
42	300001	特锐德	16,407,045.59	2.37
43	600528	中铁二局	16,163,718.50	2.33
44	600312	平高电气	15,972,846.18	2.30
45	600125	铁龙物流	15,174,114.00	2.19
46	002051	中工国际	14,962,042.13	2.16

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,945,569,191.17
卖出股票收入（成交）总额	2,070,354,304.54

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

## 8.6 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。

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

## 8.8 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贵金属投资明细

注：无。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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、或在报告编制日一年内受到公开谴责、处罚的证券。

### 8.12.2

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。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,250,829.65
2	应收证券清算款	2,548,415.08
3	应收股利	-
4	应收利息	9,076.88
5	应收申购款	155,647.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,963,969.23

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：无。

**8.12.5 期末股票中存在流通受限情况的说明****8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601018	宁波港	23,682,482.32	3.42	重大事项

**8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

注：无。

**8.12.6 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。

**§ 9 基金份额持有人信息****9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
带路分级	30,640	20,308.99	9,140,108.74	1.47%	613,127,364.26	98.53%
带路 A	1,284	48,158.32	42,861,414.00	69.32%	18,973,865.00	30.68%
带路 B	6,747	9,164.86	2,629,349.00	4.25%	59,205,930.00	95.75%
合计	38,671	19,289.34	54,630,871.74	7.32%	691,307,159.26	92.68%

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

### 带路 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	新华人寿保险股份有限公司	15,769,229.00	25.50%
2	银华财富资本—工商银行—银华财 富资产管理（北京）有限公司	8,364,824.00	13.53%
3	中国财产再保险有限责任公司	4,830,408.00	7.81%
4	鹏华基金鹏诚理财安进 20 期多策略 稳健 2 号资产管理计划	3,206,333.00	5.19%
5	富安达基金—中信建投证券—富安 达—道冲套利 1 号资产管理计	1,574,827.00	2.55%
6	北京奥通达投资咨询有限公司	1,374,325.00	2.22%
7	郭琴	1,178,991.00	1.91%
8	银河资本—招商银行—涌悦进取 1 号资产管理计划	1,100,000.00	1.78%
9	深圳市上善若水资产管理有限公司 —上善若水厚德稳健增值基金	1,000,000.00	1.62%
9	霍鸣庆	1,000,000.00	1.62%
10	中信信托有限责任公司—上善若水 3 期成长策略精选管理型证券	775,246.00	1.25%

### 带路 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	龙仁杰	3,160,825.00	5.11%
2	富安达基金—中信建投证券—富安 达—道冲套利 1 号资产管理计	1,846,600.00	2.99%
3	周科	1,250,000.00	2.02%
4	刘长江	1,000,000.00	1.62%
5	欧培青	788,100.00	1.27%
6	毕培艺	693,309.00	1.12%
7	刘秋萌	667,382.00	1.08%

8	张桢炎	616,414.00	1.00%
9	刘国兴	557,300.00	0.90%
10	王念东	556,588.00	0.90%

注：持有人为场内持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	带路分级	1,903.88	0.0003%
	带路 A	-	-
	带路 B	-	-
	合计	1,903.88	0.0003%

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理本报告期末未持有本基金份额。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	带路分级	带路 A	带路 B
基金合同生效日（2015 年 5 月 18 日）基金份额总额	314,132,954.93	146,134,555.00	146,134,555.00
本报告期期初基金份额总额	-	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,035,743,339.59	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,860,795,424.27	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-866,813,397.25	-84,299,276.00	-84,299,276.00
本报告期期末基金份额总额	622,267,473.00	61,835,279.00	61,835,279.00

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份额折算中调整的份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 报告期内基金管理人的重大人事变动：

报告期内，经公司董事会审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]217 号文核准，公司聘任高永杰先生担任公司督察长，任职日期自 2015 年 2 月 6 日起。

报告期内，经公司董事会审议通过，自 2015 年 9 月 19 日起，同意聘任苏波先生担任公司副总经理。

报告期内，公司原副总经理胡湘先生因个人职业发展原因提出辞职，经公司董事会审议，同意胡湘先生提出的辞职申请，并同意其在办理完工作交接手续后正式离任。胡湘先生于 2015 年 10 月 17 日正式离任。

报告期内，经公司董事会审议通过，自 2015 年 10 月 17 日起，同意聘任邢彪先生担任公司副总经理。

上述事项已按有关规定向中国证券监督管理委员会及深圳证监局报告，并按有关规定向中国证券投资基金业协会备案。

11.2.2 报告期内基金托管人的重大人事变动：

报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 100,000.00 元。该审计机构为本基金提供审计服务的期间为本基金基金合同生效日(2015 年 5 月 18 日)起到本报告

期末，不满一年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	13,777,820,957.03	62.80%	3,358,254.52	62.80%	本报告期新增
中泰证券	1	11,125,245,814.74	18.71%	998,682.34	18.67%	本报告期新增
广发证券	1	740,294,360.02	12.31%	651,676.05	12.19%	本报告期新增
东北证券	1	245,460,039.73	4.08%	223,690.93	4.18%	本报告期新增
川财证券	1	113,098,084.67	1.88%	103,061.91	1.93%	本报告期新增
安信证券	1	13,784,869.52	0.23%	12,562.58	0.23%	本报告期新增
国金证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
东方证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
西南证券	2	-	-	-	-	本报告期新增

注：交易单元选择的标准和程序

1、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

## 2、选择交易单位的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单位的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	-	2,349,900,000.00	100.00%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金合同摘要、份额发售公告及招募说明书	证券时报	2015年5月5日
2	鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金合同摘要、	中国证券报	2015年5月6日

	份额发售公告及招募说明书		
3	鹏华基金管理有限公司关于增加中国国际金融有限公司为我司旗下部分基金代销机构的公告	三大证券报	2015 年 5 月 8 日
4	鹏华基金管理有限公司关于增加中国建设银行为鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金代销机构的公告	三大证券报	2015 年 5 月 8 日
5	鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金上网发售提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 8 日
6	关于鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金提前结束募集的公告	三大证券报	2015 年 5 月 13 日
7	鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同生效公告	三大证券报	2015 年 5 月 19 日
8	鹏华基金管理有限公司关于增加中信建投期货有限公司为我司旗下部分基金代销机构的公告	三大证券报	2015 年 5 月 19 日
9	鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金之带路 A 与带路 B 上市交易公告书	三大证券报	2015 年 5 月 20 日
10	关于鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金开通跨系统转托管业务的公告	三大证券报	2015 年 5 月 20 日
11	关于鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金开通份额配对转换业务的公告	三大证券报	2015 年 5 月 20 日
12	鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	三大证券报	2015 年 5 月 21 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 22 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 22 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 22 日

16	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 22 日
17	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 22 日
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 22 日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 22 日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 22 日
21	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 22 日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 23 日
23	鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金 A、B 份额上市交易提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 25 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 26 日
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 26 日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 26 日
27	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 26 日
28	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 26 日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 27 日
30	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后	三大证券报	2015 年 5 月 27 日

	估值方法变更的提示性公告		
31	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 27 日
32	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 27 日
33	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 27 日
34	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 27 日
35	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 28 日
36	鹏华基金管理有限公司关于增加中国工商银行为鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金代销机构的公告	三大证券报	2015 年 5 月 28 日
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 29 日
38	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 5 月 29 日
39	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 2 日
40	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 2 日
41	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 3 日
42	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 3 日
43	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 3 日
44	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 3 日

45	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 3 日
46	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 6 日
47	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 9 日
48	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 9 日
49	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 11 日
50	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与华鑫证券自助式交易系统投资费率优惠活动公告	三大证券报	2015 年 6 月 11 日
51	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与平安证券网上交易申购费率优惠活动的公告	三大证券报	2015 年 6 月 12 日
52	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 12 日
53	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 13 日
54	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 13 日
55	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 16 日
56	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 17 日
57	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 17 日
58	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 18 日

59	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 19 日
60	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 19 日
61	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 19 日
62	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 19 日
63	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 19 日
64	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 19 日
65	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 20 日
66	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 20 日
67	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 20 日
68	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 20 日
69	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 20 日
70	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 20 日
71	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 20 日
72	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 20 日
73	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后	三大证券报	2015 年 6 月 20 日

	估值方法变更的提示性公告		
74	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 20 日
75	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 20 日
76	鹏华基金管理有限公司关于增加上海银行股份有限公司为鹏华旗下部分开放式基金销售机构的公告	三大证券报	2015 年 6 月 23 日
77	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 24 日
78	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 26 日
79	鹏华基金关于新增南京银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	三大证券报	2015 年 6 月 26 日
80	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 27 日
81	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 27 日
82	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 27 日
83	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 27 日
84	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 27 日
85	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 27 日
86	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 27 日
87	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 27 日

88	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 27 日
89	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 27 日
90	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 30 日
91	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 30 日
92	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 30 日
93	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 30 日
94	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 30 日
95	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 30 日
96	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 30 日
97	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 30 日
98	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 30 日
99	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 30 日
100	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 6 月 30 日
101	鹏华基金旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	三大证券报	2015 年 6 月 30 日
102	鹏华基金管理有限公司关于	三大证券报	2015 年 7 月 1 日

	旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告		
103	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 1 日
104	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与长城证券网上交易申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	三大证券报	2015 年 7 月 1 日
105	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 2 日
106	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 2 日
107	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 3 日
108	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 3 日
109	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 3 日
110	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 3 日
111	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 3 日
112	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 3 日
113	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 3 日
114	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 4 日
115	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 4 日
116	鹏华基金管理有限公司关于	三大证券报	2015 年 7 月 4 日

	旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告		
117	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 4 日
118	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 4 日
119	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 4 日
120	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 4 日
121	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 4 日
122	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 4 日
123	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 4 日
124	鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	三大证券报	2015 年 7 月 4 日
125	鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	三大证券报	2015 年 7 月 4 日
126	鹏华基金管理有限公司关于公司、高级管理人员及基金经理投资旗下基金相关事宜的公告	三大证券报	2015 年 7 月 6 日
127	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 7 日
128	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 7 日
129	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 7 日
130	鹏华基金管理有限公司关于	三大证券报	2015 年 7 月 7 日

	旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告		
131	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 7 日
132	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 7 日
133	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 7 日
134	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 7 日
135	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 7 日
136	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
137	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
138	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
139	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
140	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
141	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
142	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
143	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
144	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日

145	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
146	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
147	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
148	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
149	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
150	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
151	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
152	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
153	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
154	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
155	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
156	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 8 日
157	鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金不定期份额折算公告	三大证券报	2015 年 7 月 9 日
158	鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金 B 类份额不定期份额折算的风险提示公告	三大证券报	2015 年 7 月 9 日
159	鹏华基金管理有限公司关于	三大证券报	2015 年 7 月 10 日

	旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告		
160	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
161	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
162	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
163	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
164	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
165	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
166	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
167	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
168	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
169	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
170	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
171	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
172	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
173	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日

174	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
175	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
176	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
177	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
178	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
179	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
180	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
181	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
182	关于鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间带路 A 份额、带路 B 份额停复牌公告	三大证券报	2015 年 7 月 10 日
183	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 11 日
184	鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告	三大证券报	2015 年 7 月 13 日
185	关于鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金不定期份额折算前收盘价调整的公告	三大证券报	2015 年 7 月 13 日
186	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 15 日
187	鹏华基金管理有限公司关于	三大证券报	2015 年 7 月 15 日

	旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告		
188	鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与长城证券网上交易申购费率优惠活动公告	三大证券报	2015 年 7 月 16 日
189	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 18 日
190	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 24 日
191	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 28 日
192	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 7 月 29 日
193	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 8 月 4 日
194	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 8 月 5 日
195	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 8 月 6 日
196	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 8 月 11 日
197	鹏华基金管理有限公司关于向员工提供无息贷款投资旗下偏股型基金的公告	三大证券报	2015 年 8 月 15 日
198	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 8 月 19 日
199	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 8 月 22 日
200	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与中国国际金融股份有限公司申购费率优惠活动的公告	三大证券报	2015 年 8 月 24 日
201	鹏华基金管理有限公司关于	三大证券报	2015 年 8 月 25 日

	旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告		
202	鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金不进行定期份额折算的提示性公告	三大证券报	2015 年 8 月 26 日
203	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 8 月 26 日
204	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 8 月 27 日
205	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 8 月 29 日
206	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 9 月 2 日
207	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 9 月 7 日
208	鹏华基金管理有限公司关于系统升级期间暂停服务的公告	三大证券报	2015 年 9 月 8 日
209	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 9 月 15 日
210	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金场内申购费率的公告	三大证券报	2015 年 9 月 16 日
211	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 9 月 16 日
212	鹏华基金管理有限公司基金高级管理人员变更公告	三大证券报	2015 年 9 月 19 日
213	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 9 月 22 日
214	鹏华基金管理有限公司关于增加中信期货有限公司为我司旗下部分基金代销机构的公告	三大证券报	2015 年 9 月 25 日
215	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后	三大证券报	2015 年 9 月 26 日

	估值方法变更的提示性公告		
216	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 10 月 9 日
217	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 10 月 10 日
218	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 10 月 13 日
219	基金高级管理人员变更公告	三大证券报	2015 年 10 月 17 日
220	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 10 月 17 日
221	鹏华基金管理有限公司关于增加东莞银行股份有限公司为旗下部分开放式基金销售机构的公告	三大证券报	2015 年 10 月 19 日
222	鹏华基金管理有限公司关于在中国工商银行开通旗下部分基金定期定额投资业务的公告	三大证券报	2015 年 10 月 21 日
223	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 10 月 21 日
224	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米财富管理有限公司基金申购费率优惠活动的公告	三大证券报	2015 年 10 月 26 日
225	鹏华基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	三大证券报	2015 年 10 月 26 日
226	2015 年第三季度报告	三大证券报	2015 年 10 月 27 日
227	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 11 月 5 日
228	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 11 月 7 日
229	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 11 月 11 日
230	鹏华基金管理有限公司关于	三大证券报	2015 年 11 月 16 日

	增加西南证券股份有限公司为我司旗下部分基金代销机构的公告		
231	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 11 月 19 日
232	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 11 月 20 日
233	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 11 月 24 日
234	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 11 月 28 日
235	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海陆金所资产管理有限公司基金申购费率优惠活动的公告	三大证券报	2015 年 11 月 29 日
236	鹏华基金管理有限公司关于增加上海陆金所资产管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	三大证券报	2015 年 11 月 29 日
237	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 12 月 18 日
238	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 12 月 18 日
239	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	三大证券报	2015 年 12 月 22 日
240	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行“2016 倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告	三大证券报	2015 年 12 月 31 日
241	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东莞银行网上银行、手机银行申购或定期定额申购费率优惠活动的公告	三大证券报	2015 年 12 月 31 日
242	关于指数熔断机制实施后鹏华基金管理有限公司旗下相	三大证券报	2015 年 12 月 31 日

	关类别公募基金开放时间调整的公告		
243	鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金更新的招募说明书摘要	三大证券报	2015 年 12 月 31 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》;
- (二)《鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金托管协议》;
- (三)《鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金 2015 年年度报告》(原文)。

### 12.2 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

深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦招商银行股份有限公司

### 12.3 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 3 月 30 日