

鹏华医疗保健股票型证券投资基金 2015 年 年度报告摘要

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 30 日

§ 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。

基金托管人中国建设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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华医疗保健股票
场内简称	-
基金主代码	000780
交易代码	000780
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 9 月 23 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
报告期末基金份额总额	2,001,476,076.20 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型基金，在有效控制风险前提下，精选优质的医疗保健行业上市公司，力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量(包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)以及各项国家政策(包括财政、货币、税收、汇率政策等)来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1) 自上而下地分析行业的成长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2) 自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p>

	<p>4、权证投资策略 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>5、中小企业私募债投资策略 中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。</p> <p>6、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。</p>
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	田青
	联系电话	0755-82825720	010-67595096
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	010-67595096
传真		0755-82021126	010-66275853

2.4 信息披露方式

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

§ 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	2014 年 9 月 23 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	220,802,477.88	4,326,894.22
本期利润	499,618,609.40	-119,588,634.73
加权平均基金份额本期利润	0.2303	-0.0537
本期基金份额净值增长率	59.34%	-5.80%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1698	-0.0576
期末基金资产净值	3,003,379,021.42	1,971,157,682.13
期末基金份额净值	1.501	0.942

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) 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 2014 年 9 月 23 日生效，至 2014 年 12 月 31 日未满一年，故 2014 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

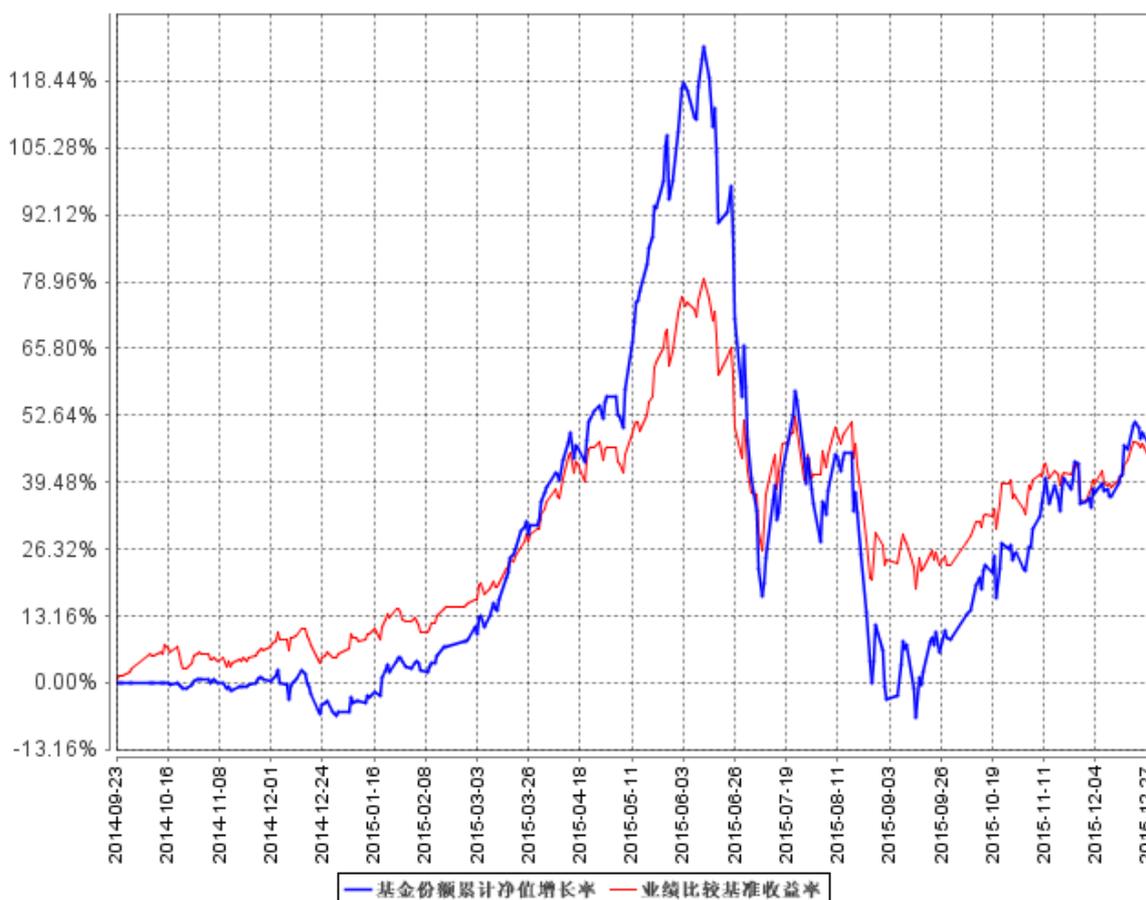
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	38.21%	2.26%	17.21%	1.52%	21.00%	0.74%
过去六个月	-9.69%	3.68%	-4.73%	2.34%	-4.96%	1.34%
过去一年	59.34%	3.14%	36.83%	2.08%	22.51%	1.06%
自基金合同生效起至今	50.10%	2.82%	44.56%	1.90%	5.54%	0.92%

注：业绩比较基准=中证医药卫生指数收益率*80%+中债总指数收益率*20%

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

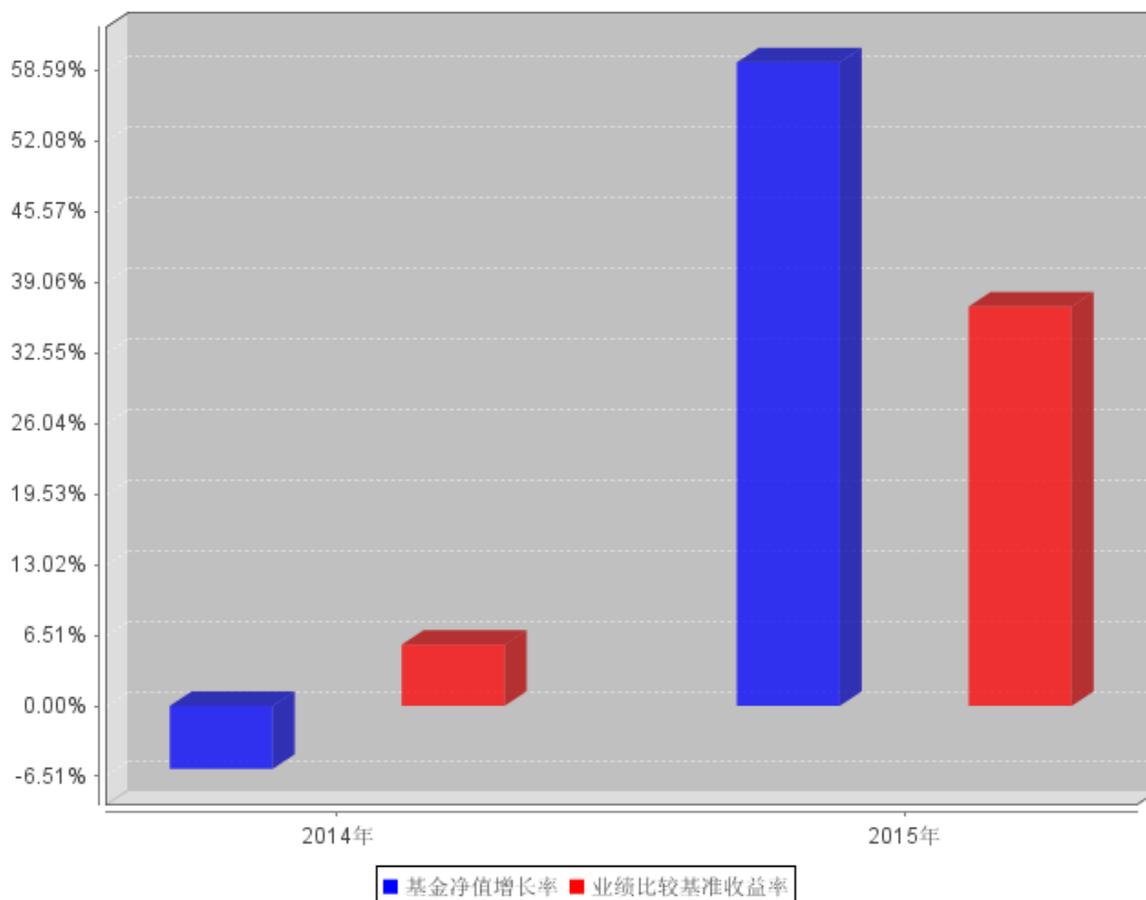


注：1、本基金基金合同于 2014 年 9 月 23 日生效。

2、本基金管理人将严格按照本基金合同的约定，于本基金建仓期届满后确保各项投资比例符合基金合同的约定。

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：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：本基金基金合同于 2014 年 9 月 23 日生效。截止本报告期末，本基金未进行利润分配。

§ 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		
梁冬冬	本基金基金经理	2014年9月23日	-	7	梁冬冬先生，国籍中国，理学硕士，7年证券从业经验。历任江海证券研究所医药行业研究员，浦银安盛基金公司研究员，华宝兴业基金公司研究员；2012年10月加盟鹏华基金管理有限公司，担任研究部资深研究员，从事行业研究工作，2014年9月起担任鹏华医疗保健股票基金基金经理，2015年6月起兼任鹏华医药科技股票基金基金经理。梁冬冬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内的公平交易程序，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

各位持有人你们好：15 年的证券市场波澜壮阔，既有上半年的大牛市，也有 6 月以来的股灾暴跌，在这里，非常感谢大家对本基金的支持。整体看，该基金虽然净值波动较大，但还是给持有人带来了较好的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 59.34%，同期上证综指上涨 9.41%，深证成指上涨 14.98%，沪深 300 指数上涨 5.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

新的一年即将开始，我将在总结 15 年经验教训的基础上，积极布局 16 年，希望能够为持有人继续提供稳定的回报。展望全年，我对行情并不悲观。首先，从市场环境看，在经历今年经济结构大幅调整后，明年实体经济有望逐步稳定，政府也有望出台温和刺激政策，整体情况偏乐观。其次，货币政策仍将维持相对宽松，政策面上，随着反腐深入进行以及各项准备就绪，明年改革逻辑有望开始兑现。基于以上经济环境，我们认为 2016 年股市整体偏暖，指数中枢缓慢上移。在配置策略上我们认为新兴产业是配置方向，成长股仍将是市场关注的重点。在选股方面，我们将围绕以下三条主线进行：首先是国企改革。明年国企改革有望加速，相关公司盈利将有明显改善，值得积极配置。其次，互联网医疗。作为互联网+重要的组成部分，互联网医疗将在医药行业发挥越来越大的作用，产业前景一片光明，将是本基金重点配置的版块。最后，科技创新。包括基因检测、细胞治疗、蛋白质药物等等。总体来说，我们对明年市场行情偏乐观，操作上也重点偏向成长股，希望能为持有人带来好的回报。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1. 截止本报告期末，本基金可供分配利润为 339,833,320.93 元，期末基金份额净值 1.501 元。

2. 本基金本报告期内未进行利润分配。

3. 根据相关法律法规及本基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

4.8 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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

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。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:鹏华医疗保健股票型证券投资基金

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	上年度末 2014年12月31日
资产:			
银行存款		450,536,560.97	159,540,364.04
结算备付金		24,267,695.62	22,076,621.10
存出保证金		2,813,698.94	340,069.55

交易性金融资产		2,456,127,153.58	1,798,353,091.23
其中：股票投资		2,456,127,153.58	1,798,353,091.23
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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		97,444,198.83	-
应收利息		81,801.33	59,108.52
应收股利		-	-
应收申购款		2,657,399.73	781,748.31
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,033,928,509.00	1,981,151,002.75
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
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		12,190,428.93	3,960,392.53
应付管理人报酬		3,682,896.03	2,687,028.58
应付托管费		613,816.01	447,838.11
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		13,630,166.40	2,722,865.44
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		432,180.21	175,195.96
负债合计		30,549,487.58	9,993,320.62
所有者权益：			
实收基金		2,001,476,076.20	2,091,620,138.31
未分配利润		1,001,902,945.22	-120,462,456.18
所有者权益合计		3,003,379,021.42	1,971,157,682.13
负债和所有者权益总计		3,033,928,509.00	1,981,151,002.75

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.501 元，基金份额总额 2,001,476,076.20 份。

7.2 利润表

会计主体：鹏华医疗保健股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 9 月 23 日(基 金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		609,812,072.66	-105,129,605.31
1. 利息收入		2,587,639.94	4,374,834.78
其中：存款利息收入		2,587,639.94	1,937,070.07
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		-	2,437,764.71
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		283,963,243.37	13,610,690.68
其中：股票投资收益		270,944,865.34	13,610,690.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		13,018,378.03	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		278,816,131.52	-123,915,528.95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		44,445,057.83	800,398.18
减：二、费用		110,193,463.26	14,459,029.42
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	44,389,849.67	9,030,003.34
2. 托管费	7.4.8.2.2	7,398,308.36	1,505,000.61
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		57,957,746.51	3,748,869.87
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		447,558.72	175,155.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		499,618,609.40	-119,588,634.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		499,618,609.40	-119,588,634.73

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华医疗保健股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 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）	2,091,620,138.31	-120,462,456.18	1,971,157,682.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	499,618,609.40	499,618,609.40
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）	-90,144,062.11	622,746,792.00	532,602,729.89
其中：1. 基金申购款	6,315,886,294.32	3,377,500,654.03	9,693,386,948.35
2. 基金赎回款	-6,406,030,356.43	-2,754,753,862.03	-9,160,784,218.46
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）	2,001,476,076.20	1,001,902,945.22	3,003,379,021.42
项目	上年度可比期间 2014 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2014 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）	2,273,167,107.58	-	2,273,167,107.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-119,588,634.73	-119,588,634.73
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）	-181,546,969.27	-873,821.45	-182,420,790.72
其中：1. 基金申购款	45,734,145.39	-434,186.62	45,299,958.77
2. 基金赎回款	-227,281,114.66	-439,634.83	-227,720,749.49
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）	2,091,620,138.31	-120,462,456.18	1,971,157,682.13

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：

<u> 邓召明 </u>	<u> 高鹏 </u>	<u> 郝文高 </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鹏华医疗保健股票型证券投资基金(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”)证监基金字[2014]第 859 号文《关于准予鹏华医疗保健股票型证券投资基金注册的批复》核准,由基金管理人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《鹏华医疗保健股票型证券投资基金基金合同》公开募集设立。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,272,037,165.23 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具普华永道中天验字(2014)第 493 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华医疗保健股票型证券投资基金基金合同》于 2014 年 9 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,273,167,107.58 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,129,942.35 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华医疗保健股票型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,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、中小企业私募债等)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。其中,股票资产占基金资产的比例为 80%—95%;投资于医疗保健行业上市公司发行的股票占非现金基金资产的比例不低于 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,基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为:中证医药卫生指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%。

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》、《鹏华医疗保健股票型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 年度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 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策变更等说明、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 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 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(“鹏华基金公司”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生股票交易、权证交易、债券交易、债券回购交易，也没有发生应支付关联方的佣金业务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 9 月 23 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	44,389,849.67	9,030,003.34

其中：支付销售机构的客户维护费	20,037,696.08	6,316,018.44
-----------------	---------------	--------------

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 1.50%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 9 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,398,308.36	1,505,000.61

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费年费率为 0.25%，逐日计提，按月支付。

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本年度及上年度可比报告期管理人未投资、持有本基金。

7.4.8.4.2 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：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

7.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		2014 年 9 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	450,536,560.97	2,258,490.05	159,540,364.04	1,844,368.61

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与关联方承销的证券。

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

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2 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	备注
600771	广誉远	2015 年 11 月 17 日	重大事项	32.97	2016 年 3 月 9 日	28.78	5,338,151	176,385,439.18	175,998,838.47	-
300036	超图软件	2015 年 10 月 30 日	重大事项	43.18	2016 年 1 月 15 日	35.11	2,999,841	106,302,086.80	129,533,134.38	-
300028	金亚科技	2015 年 6 月 10 日	重大事项	24.48	-	-	4,809,598	191,074,459.32	117,738,959.04	-
300054	鼎龙股份	2015 年 11 月 23 日	重大事项	24.66	2016 年 3 月 14 日	22.19	1,499,922	34,474,957.23	36,988,076.52	-
300326	凯利泰	2015 年 9 月 24 日	重大事项	27.92	2016 年 1 月 22 日	23.98	899,930	18,672,209.14	25,126,045.60	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

§ 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	2,456,127,153.58	80.96
	其中：股票	2,456,127,153.58	80.96
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	474,804,256.59	15.65
7	其他各项资产	102,997,098.83	3.39
8	合计	3,033,928,509.00	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	1,968,176,163.48	65.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,349,073.75	0.41
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	122,050,541.23	4.06
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	140,483,134.38	4.68
J	金融业	-	-
K	房地产业	78,898,315.68	2.63
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	134,169,925.06	4.47
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	2,456,127,153.58	81.78
--	----	------------------	-------

8.3 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

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	600085	同仁堂	5,399,897	240,889,405.17	8.02
2	300083	劲胜精密	3,780,516	178,894,017.12	5.96
3	600771	广誉远	5,338,151	175,998,838.47	5.86
4	603998	方盛制药	2,898,280	147,899,228.40	4.92
5	002614	蒙发利	7,599,768	147,359,501.52	4.91
6	002370	亚太药业	4,023,172	142,540,983.96	4.75
7	600479	千金药业	6,699,905	140,497,007.85	4.68
8	002173	千足珍珠	5,169,225	135,123,541.50	4.50
9	002675	东诚药业	2,399,910	134,418,959.10	4.48
10	300347	泰格医药	4,364,669	134,169,925.06	4.47

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站 <http://www.phfund.com> 的年度报告正文。

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	300347	泰格医药	402,657,710.39	20.43
2	600771	广誉远	400,516,453.82	20.32
3	002675	东诚药业	334,391,644.64	16.96
4	300171	东富龙	282,645,217.94	14.34
5	300028	金亚科技	270,543,300.40	13.73
6	000078	海王生物	266,443,715.73	13.52
7	300006	莱美药业	253,898,572.39	12.88
8	002390	信邦制药	222,664,651.66	11.30
9	002183	怡亚通	219,723,802.11	11.15
10	600694	大商股份	218,189,767.28	11.07
11	300244	迪安诊断	217,459,590.65	11.03
12	002001	新和成	213,553,325.21	10.83

13	300430	诚益通	210,676,591.31	10.69
14	002693	双成药业	207,534,375.51	10.53
15	601988	中国银行	205,358,242.18	10.42
16	600479	千金药业	201,720,166.87	10.23
17	300083	劲胜精密	198,024,318.63	10.05
18	000402	金融街	196,343,996.53	9.96
19	300206	理邦仪器	194,777,458.48	9.88
20	601186	中国铁建	188,441,144.81	9.56
21	601600	中国铝业	185,897,688.26	9.43
22	002173	千足珍珠	180,955,463.80	9.18
23	002348	高乐股份	179,190,606.39	9.09
24	601398	工商银行	177,071,474.82	8.98
25	601800	中国交建	171,281,388.89	8.69
26	000638	万方发展	169,312,475.86	8.59
27	600085	同仁堂	167,767,285.91	8.51
28	000998	隆平高科	162,741,907.80	8.26
29	600664	哈药股份	159,566,167.72	8.10
30	300146	汤臣倍健	157,354,429.53	7.98
31	601919	中国远洋	157,332,083.07	7.98
32	600713	南京医药	156,184,116.85	7.92
33	600436	片仔癀	153,910,058.59	7.81
34	002370	亚太药业	152,988,510.47	7.76
35	600829	人民同泰	151,599,616.92	7.69
36	002157	正邦科技	149,619,428.87	7.59
37	000002	万科A	146,728,549.53	7.44
38	002614	蒙发利	146,495,482.50	7.43
39	603998	方盛制药	143,911,319.53	7.30
40	300015	爱尔眼科	142,626,305.84	7.24
41	600750	江中药业	139,179,710.05	7.06
42	000538	云南白药	131,117,328.02	6.65
43	002616	长青集团	128,621,195.59	6.53
44	601198	东兴证券	125,907,077.84	6.39
45	002133	广宇集团	123,507,189.48	6.27
46	300339	润和软件	119,239,874.55	6.05
47	603088	宁波精达	117,163,102.72	5.94
48	002758	华通医药	116,599,178.71	5.92

49	600520	中发科技	114,121,302.31	5.79
50	002084	海鸥卫浴	113,931,923.29	5.78
51	603222	济民制药	113,789,639.02	5.77
52	000960	锡业股份	113,336,060.62	5.75
53	002235	安妮股份	112,934,993.85	5.73
54	601669	中国电建	112,575,215.35	5.71
55	000915	山大华特	112,263,628.49	5.70
56	300319	麦捷科技	112,213,269.85	5.69
57	600016	民生银行	108,769,084.71	5.52
58	601989	中国重工	108,703,093.09	5.51
59	601866	中海集运	106,653,764.39	5.41
60	300036	超图软件	106,302,086.80	5.39
61	600252	中恒集团	105,912,332.16	5.37
62	300300	汉鼎股份	103,272,185.72	5.24
63	000516	国际医学	101,649,202.92	5.16
64	603008	喜临门	101,319,211.56	5.14
65	000802	北京文化	99,365,049.31	5.04
66	603118	共进股份	99,232,547.40	5.03
67	000705	浙江震元	98,437,159.01	4.99
68	600976	健民集团	97,186,524.07	4.93
69	002159	三特索道	96,309,613.00	4.89
70	600010	包钢股份	95,077,878.82	4.82
71	000919	金陵药业	93,935,394.06	4.77
72	300464	星徽精密	93,758,129.52	4.76
73	300147	香雪制药	92,131,837.99	4.67
74	600018	上港集团	91,386,302.00	4.64
75	300089	文化长城	91,343,138.88	4.63
76	002262	恩华药业	90,534,907.03	4.59
77	601106	中国一重	89,690,620.73	4.55
78	600513	联环药业	89,192,918.66	4.52
79	002351	漫步者	86,691,082.52	4.40
80	600029	南方航空	85,478,873.50	4.34
81	600485	信威集团	84,505,256.64	4.29
82	002178	延华智能	83,548,364.17	4.24
83	600386	北巴传媒	83,217,850.92	4.22
84	000601	韶能股份	83,176,218.25	4.22

85	600178	东安动力	83,095,209.59	4.22
86	603111	康尼机电	82,635,534.95	4.19
87	300410	正业科技	80,654,590.12	4.09
88	600285	羚锐制药	80,614,663.70	4.09
89	603369	今世缘	79,965,399.18	4.06
90	002681	奋达科技	79,684,852.70	4.04
91	300326	凯利泰	79,322,793.33	4.02
92	600594	益佰制药	78,647,205.66	3.99
93	600240	华业资本	78,350,797.42	3.97
94	002587	奥拓电子	75,685,546.77	3.84
95	600894	广日股份	75,043,977.24	3.81
96	002034	美欣达	74,949,964.40	3.80
97	300115	长盈精密	74,889,301.44	3.80
98	300439	美康生物	74,128,716.08	3.76
99	600596	新安股份	72,278,023.87	3.67
100	601567	三星医疗	72,122,214.42	3.66
101	300309	吉艾科技	71,263,667.89	3.62
102	000566	海南海药	71,053,626.78	3.60
103	600716	凤凰股份	70,408,438.99	3.57
104	002411	九九久	69,801,761.16	3.54
105	600521	华海药业	69,618,874.88	3.53
106	300108	双龙股份	68,863,505.84	3.49
107	000650	仁和药业	68,262,299.18	3.46
108	002385	大北农	68,105,330.43	3.46
109	603167	渤海轮渡	68,059,530.86	3.45
110	603019	中科曙光	67,882,828.80	3.44
111	002081	金螳螂	67,579,681.18	3.43
112	000782	美达股份	66,914,634.40	3.39
113	600518	康美药业	65,215,107.53	3.31
114	600048	保利地产	63,974,974.56	3.25
115	002576	通达动力	62,867,429.84	3.19
116	601288	农业银行	62,700,000.00	3.18
117	600111	北方稀土	62,588,442.52	3.18
118	000952	广济药业	62,339,626.22	3.16
119	300039	上海凯宝	62,209,279.85	3.16
120	600201	生物股份	60,991,765.38	3.09

121	002422	科伦药业	59,506,531.06	3.02
122	002584	西陇科学	58,711,784.16	2.98
123	300314	戴维医疗	58,387,413.31	2.96
124	002016	世荣兆业	57,883,693.73	2.94
125	002412	汉森制药	57,549,585.17	2.92
126	300026	红日药业	57,537,698.41	2.92
127	601118	海南橡胶	57,099,070.58	2.90
128	300017	网宿科技	56,442,705.81	2.86
129	600080	金花股份	56,133,266.16	2.85
130	000908	景峰医药	55,660,497.06	2.82
131	002474	榕基软件	55,112,564.72	2.80
132	002202	金风科技	55,027,291.86	2.79
133	600812	华北制药	54,773,339.69	2.78
134	300085	银之杰	53,978,994.36	2.74
135	601599	鹿港科技	53,641,223.87	2.72
136	600998	九州通	53,187,965.97	2.70
137	600055	华润万东	51,197,988.00	2.60
138	600439	瑞贝卡	51,045,482.03	2.59
139	300420	五洋科技	50,206,088.44	2.55
140	601336	新华保险	50,139,769.35	2.54
141	002714	牧原股份	50,025,424.50	2.54
142	603609	禾丰牧业	49,563,537.96	2.51
143	002097	山河智能	48,181,489.80	2.44
144	600519	贵州茅台	48,030,578.60	2.44
145	600962	*ST 中鲁	47,590,682.68	2.41
146	002004	华邦健康	47,555,410.85	2.41
147	601668	中国建筑	47,037,638.98	2.39
148	002280	联络互动	46,438,226.40	2.36
149	002172	澳洋科技	45,545,115.52	2.31
150	002177	御银股份	44,787,455.67	2.27
151	600566	济川药业	43,403,104.77	2.20
152	000890	法尔胜	42,902,507.77	2.18
153	300071	华谊嘉信	42,846,347.21	2.17
154	002432	九安医疗	42,789,729.28	2.17
155	002007	华兰生物	42,049,178.61	2.13
156	300205	天喻信息	41,229,751.41	2.09

157	000606	青海明胶	41,193,501.00	2.09
158	300219	鸿利光电	40,854,655.46	2.07
159	603001	奥康国际	40,631,296.02	2.06
160	601169	北京银行	40,103,728.57	2.03
161	002105	信隆实业	39,910,789.28	2.02
162	300310	宜通世纪	39,783,725.94	2.02

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	002390	信邦制药	395,737,481.30	20.08
2	600771	广誉远	350,800,037.87	17.80
3	600750	江中药业	347,672,788.98	17.64
4	300171	东富龙	297,970,111.97	15.12
5	600694	大商股份	288,727,898.77	14.65
6	600664	哈药股份	275,866,258.48	14.00
7	002183	怡亚通	275,254,891.32	13.96
8	600829	人民同泰	252,044,029.56	12.79
9	601919	中国远洋	249,404,490.40	12.65
10	300206	理邦仪器	245,753,100.21	12.47
11	000078	海王生物	227,739,908.07	11.55
12	000402	金融街	217,288,930.65	11.02
13	600436	片仔癀	210,720,794.18	10.69
14	300314	戴维医疗	210,012,965.44	10.65
15	601988	中国银行	206,685,456.80	10.49
16	002675	东诚药业	204,186,653.56	10.36
17	300244	迪安诊断	203,729,372.81	10.34
18	300347	泰格医药	199,864,444.79	10.14
19	002348	高乐股份	191,212,795.08	9.70
20	002157	正邦科技	190,269,376.69	9.65
21	601600	中国铝业	182,051,352.16	9.24
22	601398	工商银行	178,020,835.96	9.03
23	601186	中国铁建	176,347,873.46	8.95
24	000002	万科A	174,472,437.92	8.85
25	300430	诚益通	172,760,446.56	8.76
26	002693	双成药业	168,891,594.82	8.57

27	000919	金陵药业	166,633,086.00	8.45
28	601800	中国交建	159,642,269.84	8.10
29	002001	新和成	155,153,664.81	7.87
30	300006	莱美药业	151,717,199.88	7.70
31	601866	中海集运	151,459,798.06	7.68
32	002616	长青集团	148,366,971.11	7.53
33	000638	万方发展	147,084,053.05	7.46
34	300239	东宝生物	139,006,646.41	7.05
35	002178	延华智能	136,808,485.19	6.94
36	300089	文化长城	134,446,732.60	6.82
37	002235	安妮股份	131,037,000.78	6.65
38	300146	汤臣倍健	130,912,110.72	6.64
39	002133	广宇集团	126,657,857.66	6.43
40	000538	云南白药	124,040,661.85	6.29
41	600614	鼎立股份	123,421,933.17	6.26
42	002758	华通医药	121,717,355.04	6.17
43	300015	爱尔眼科	120,034,654.28	6.09
44	600479	千金药业	119,646,154.01	6.07
45	000915	山大华特	119,378,070.33	6.06
46	601198	东兴证券	118,147,203.19	5.99
47	300039	上海凯宝	117,803,518.88	5.98
48	002351	漫步者	117,287,589.02	5.95
49	000802	北京文化	116,578,506.82	5.91
50	000998	隆平高科	116,516,332.76	5.91
51	600713	南京医药	115,807,627.77	5.88
52	300464	星徽精密	115,568,388.04	5.86
53	600029	南方航空	115,477,754.23	5.86
54	002349	精华制药	113,655,864.79	5.77
55	000960	锡业股份	113,651,563.76	5.77
56	600016	民生银行	113,356,336.13	5.75
57	600520	中发科技	113,345,750.11	5.75
58	300319	麦捷科技	111,991,071.96	5.68
59	600010	包钢股份	111,386,611.11	5.65
60	601669	中国电建	111,385,598.36	5.65
61	300339	润和软件	108,150,099.39	5.49
62	002262	恩华药业	105,578,903.80	5.36
63	603088	宁波精达	99,109,950.53	5.03
64	000601	韶能股份	98,560,104.33	5.00

65	600252	中恒集团	98,437,652.82	4.99
66	002173	千足珍珠	98,291,562.39	4.99
67	300147	香雪制药	97,913,170.77	4.97
68	300326	凯利泰	97,050,373.02	4.92
69	002385	大北农	96,307,940.52	4.89
70	300083	劲胜精密	95,811,285.46	4.86
71	600018	上港集团	95,526,909.52	4.85
72	600485	信威集团	93,362,351.12	4.74
73	600351	亚宝药业	92,052,778.02	4.67
74	600178	东安动力	90,869,439.71	4.61
75	601989	中国重工	90,194,069.83	4.58
76	300300	汉鼎股份	89,904,939.61	4.56
77	002159	三特索道	89,291,035.66	4.53
78	600285	羚锐制药	88,736,113.57	4.50
79	300028	金亚科技	88,361,791.59	4.48
80	600976	健民集团	88,165,676.78	4.47
81	603111	康尼机电	87,882,796.68	4.46
82	600894	广日股份	85,261,723.05	4.33
83	600521	华海药业	84,536,568.13	4.29
84	600055	华润万东	83,144,173.83	4.22
85	603118	共进股份	83,017,015.14	4.21
86	600240	华业资本	82,965,965.83	4.21
87	600596	新安股份	82,932,753.42	4.21
88	300439	美康生物	81,483,481.97	4.13
89	002034	美欣达	81,147,762.10	4.12
90	000566	海南海药	80,222,146.99	4.07
91	600594	益佰制药	79,998,650.97	4.06
92	300108	双龙股份	79,512,626.70	4.03
93	002275	桂林三金	78,240,591.20	3.97
94	600085	同仁堂	77,827,360.57	3.95
95	600566	济川药业	77,596,249.50	3.94
96	603369	今世缘	76,195,112.27	3.87
97	600518	康美药业	75,468,324.45	3.83
98	300309	吉艾科技	75,149,478.55	3.81
99	002681	奋达科技	73,713,338.27	3.74
100	601607	上海医药	72,915,422.27	3.70
101	002084	海鸥卫浴	72,842,164.24	3.70
102	002223	鱼跃医疗	72,307,325.25	3.67

103	600048	保利地产	71,710,053.22	3.64
104	603167	渤海轮渡	71,686,256.43	3.64
105	002587	奥拓电子	71,217,969.83	3.61
106	000650	仁和药业	68,747,076.62	3.49
107	300410	正业科技	68,538,482.42	3.48
108	601288	农业银行	66,733,000.00	3.39
109	000516	国际医学	66,312,018.78	3.36
110	002081	金螳螂	66,064,577.87	3.35
111	601231	环旭电子	65,976,244.37	3.35
112	600420	现代制药	65,698,576.14	3.33
113	002007	华兰生物	65,577,065.38	3.33
114	002202	金风科技	64,023,311.71	3.25
115	300026	红日药业	63,551,028.88	3.22
116	002576	通达动力	63,341,450.36	3.21
117	000590	*ST 古汉	63,291,991.45	3.21
118	600080	金花股份	62,864,183.94	3.19
119	002422	科伦药业	62,151,580.39	3.15
120	002016	世荣兆业	61,859,332.38	3.14
121	002551	尚荣医疗	61,857,271.54	3.14
122	000952	广济药业	61,791,637.18	3.13
123	300086	康芝药业	61,334,628.76	3.11
124	600111	北方稀土	60,560,337.04	3.07
125	600812	华北制药	60,446,368.82	3.07
126	603019	中科曙光	60,112,192.12	3.05
127	300085	银之杰	59,673,976.00	3.03
128	002474	榕基软件	59,470,082.60	3.02
129	601106	中国一重	58,684,805.43	2.98
130	000908	景峰医药	57,918,409.84	2.94
131	300115	长盈精密	55,942,210.52	2.84
132	601118	海南橡胶	55,601,774.11	2.82
133	601336	新华保险	54,954,432.58	2.79
134	002004	华邦健康	53,029,962.43	2.69
135	600998	九州通	51,908,506.89	2.63
136	600386	北巴传媒	51,245,677.16	2.60
137	300420	五洋科技	51,101,250.80	2.59
138	600519	贵州茅台	50,989,863.49	2.59
139	002280	联络互动	50,466,196.54	2.56
140	601668	中国建筑	49,525,331.30	2.51

141	002737	葵花药业	49,355,815.04	2.50
142	000890	法尔胜	48,703,755.62	2.47
143	002432	九安医疗	48,565,536.48	2.46
144	600201	生物股份	48,169,994.00	2.44
145	600962	*ST 中鲁	48,012,464.10	2.44
146	300017	网宿科技	47,963,460.43	2.43
147	300071	华谊嘉信	47,279,084.40	2.40
148	002714	牧原股份	45,763,516.55	2.32
149	002273	水晶光电	45,523,520.00	2.31
150	601599	鹿港科技	45,305,873.91	2.30
151	603222	济民制药	44,874,410.67	2.28
152	600789	鲁抗医药	44,528,936.92	2.26
153	002324	普利特	44,155,595.33	2.24
154	002172	澳洋科技	43,730,187.36	2.22
155	600439	瑞贝卡	42,807,077.58	2.17
156	300219	鸿利光电	42,657,062.39	2.16
157	300142	沃森生物	42,346,819.46	2.15
158	002177	御银股份	42,323,072.67	2.15
159	601169	北京银行	42,232,724.98	2.14
160	002097	山河智能	41,051,847.59	2.08
161	603008	喜临门	40,951,551.18	2.08
162	002105	信隆实业	40,721,354.97	2.07
163	600165	新日恒力	40,197,828.84	2.04
164	000892	星美联合	39,595,545.00	2.01

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	19,391,183,980.42
卖出股票收入（成交）总额	19,283,170,914.93

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

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

无。

8.7 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。

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

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

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：本基金本报告期末发生股指期货投资。

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，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

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之一的烟台东诚药业集团股份有限公司（简称“东诚药业”或“公司”）于 2015 年 10 月 27 日公告，其股东烟台金业收到中国证券监督管理委员会《行政处罚决定书》，具体情况如下：

一、中国证监会《行政处罚决定书》（[2015]37 号）

1、主要内容

依据《中华人民共和国证券法》（以下简称《证券法》）的有关规定，我会对烟台金业违法减持的行为进行了立案调查、审理，并依法向当事人告知了作出行政处罚的事实、理由、依据及当事人依法享有的权利。当事人均未提出陈述、申辩意见，也未要求听证。本案现已审理终结。

结。

经查明，烟台金业存在以下违法事实：

烟台金业在此次减持前持有烟台东诚药业集团股份有限公司（以下简称“东诚药业”）股份 34,452,000 股，占东诚药业股份总数的 19.94%。烟台金业于 2014 年 8 月 18 日至 2015 年 6 月 3 日期间，通过证券交易所系统以集中竞价交易方式减持东诚药业股份，累计减持“东诚药业”8,953,440 股，占东诚药业总股本的 5.18%。

烟台金业减持“东诚药业”累计达到 5%时，未及时向中国证监会和深圳证券交易所提交书面报告。在没有报告、公告的情况下，烟台金业未停止买卖股票。烟台金业减持“东诚药业”已发行股份 5%以后，违规减持股数为 313,440 股，占东诚药业总股本的 0.18%，违规减持金额为 20,613,060.80 元。

以上事实，有权益变动报告书、交易流水、当事人的相关事项说明等证据证明，足以认定。

烟台金业的上述行为违反了《证券法》第三十八条“依法发行的股票、公司债券及其他证券，法律对其转让期限有限制性规定的，在限定的期限内不得买卖”及第八十六条第二款“投资者持有或者通过协议、其他安排与他人共同持有有一个上市公司已发行的股份达到百分之五后，其所持该上市公司已发行的股份比例每增加或者减少百分之五，应当依照前款规定进行报告和公告。在报告期限内和作出报告、公告后二日内，不得再行买卖该上市公司的股票”的规定，构成《证券法》第一百九十三条第二款所述“发行人、上市公司或者其他信息披露义务人未按照规定报送有关报告”及第二百零四条所述“违反法律规定，在限制转让期内买卖证券”行为。对烟台金业的违法行为，时任烟台金业执行董事的温雷是直接负责的主管人员。

根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，根据《证券法》第一百九十三条第二款、第二百零四条的规定，我会决定：

一、责令烟台金业改正，在收到行政处罚决定书之日起 3 日内对超比例减持情况进行报告和公告。

二、对烟台金业超比例减持未披露及限制转让期内的减持行为予以警告，同时对直接负责的主管人员温雷予以警告。

三、对烟台金业超比例减持未披露行为处以 40 万元罚款，对烟台金业在限制转让期内的减持行为处以 100 万元罚款，合计罚款 140 万元。对烟台金业超比例减持未披露行为直接负责的主管人员温雷处以 20 万元罚款，对烟台金业限制转让期内的减持行为直接负责的主管人员温雷处以 20 万元罚款，合计罚款 40 万元。上述当事人应自收到本处罚决定书之日起 15 日内，将罚没款汇交中国证券监督管理委员会指定账号，并将注有当事人名称的付款凭证复印件送中国证券监督管理委员会稽查局备案。当事人如果对本处罚决定不服，可在收到本处罚决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会申请行政复议，也可在收到本处罚决定书之日起 6 个月内直接向有管辖权的人民法院提起行政诉讼。复议和诉讼期间，上述决定不停止执行。

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该股票，东诚药业产品力强，具备较好的投资价值。从监管措施公告中知悉，相关问题对于公司经营并不构成重大实质性影响。对东诚药业的财务状况及经营成果并不产生重大实质性影响。本次监管措施对该股票的投资价值不产生重大影响。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。

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	2,813,698.94
2	应收证券清算款	97,444,198.83
3	应收股利	-
4	应收利息	81,801.33
5	应收申购款	2,657,399.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	102,997,098.83

8.12.4 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。

8.12.5 期末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	600771	广誉远	175,998,838.47	5.86	重大事项

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
83,523	23,963.17	469,760,115.01	23.47%	1,531,715,961.19	76.53%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	611,795.95	0.0306%

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。

9.3 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人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

基金合同生效日（2014年9月23日）基金份额总额	2,273,167,107.58
本报告期期初基金份额总额	2,091,620,138.31
本报告期基金总申购份额	6,315,886,294.32
减：本报告期基金总赎回份额	6,406,030,356.43
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,001,476,076.20

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 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

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。

报告期内基金托管人的重大人事变动：

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

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

本报告期内未改聘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两年。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	
安信证券	1	2,393,603,670.33	6.19%	2,147,647.03	6.18%	本报告期新增
长江证券	1	493,021,903.58	1.27%	449,289.19	1.29%	本报告期新增
方正证券	1	256,040,139.98	0.66%	229,470.69	0.66%	-
光大证券	1	1,481,832,079.31	3.83%	1,350,386.71	3.88%	本报告期新增
广发证券	1	940,793,763.59	2.43%	853,682.43	2.46%	本报告期新增
国泰君安	1	664,328,075.21	1.72%	592,289.04	1.70%	-
海通证券	1	1,103,574,015.39	2.85%	999,344.55	2.87%	-
宏源证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
华创证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	856,086,010.26	2.21%	767,232.13	2.21%	本报告期新增
平安证券	1	2,321,135,647.78	6.00%	2,090,860.30	6.01%	-
西南证券	1	4,204,343,145.06	10.87%	3,753,990.71	10.80%	本报告期新增
湘财证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
兴业证券	1	58,530,552.59	0.15%	53,339.48	0.15%	本报告期新增
银河证券	2	19,496,574,959.90	50.41%	17,527,252.82	50.42%	本报告期新增一个席位
招商证券	1	1,188,979,701.99	3.07%	1,072,636.04	3.09%	本报告期新增
中航证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
中金公司	1	1,241,577,459.35	3.21%	1,112,958.15	3.20%	本报告期新增
中泰证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
中投证券	1	473,850,399.65	1.23%	420,496.62	1.21%	本报告期新增
中信建投	1	426,044,132.02	1.10%	382,063.15	1.10%	本报告期新增
中信证券	1	1,074,039,239.36	2.78%	959,480.29	2.76%	-

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) 选择交易单元的程序:

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元的对象。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

注: 本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

鹏华基金管理有限公司
2016 年 3 月 30 日