

# 鹏华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)2016 年第 4 季度报告

2016 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 1 月 19 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 1 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	鹏华沪深 300 指数(LOF)
场内简称	鹏华沪深 300 指数(LOF)
交易代码	160615
基金主代码	160615
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2009 年 4 月 3 日
报告期末基金份额总额	194,621,356.39 份
投资目标	采用指数化投资方式，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化，力争将日平均跟踪误差控制在 0.35%以内，以实现沪深 300 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法，按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、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，并辅之以金融衍生产品投资管理等，使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，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，

	为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年10月1日—2016年12月31日）
1. 本期已实现收益	3,275,066.86
2. 本期利润	7,376,118.71
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0377
4. 期末基金资产净值	253,495,211.24
5. 期末基金份额净值	1.303

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

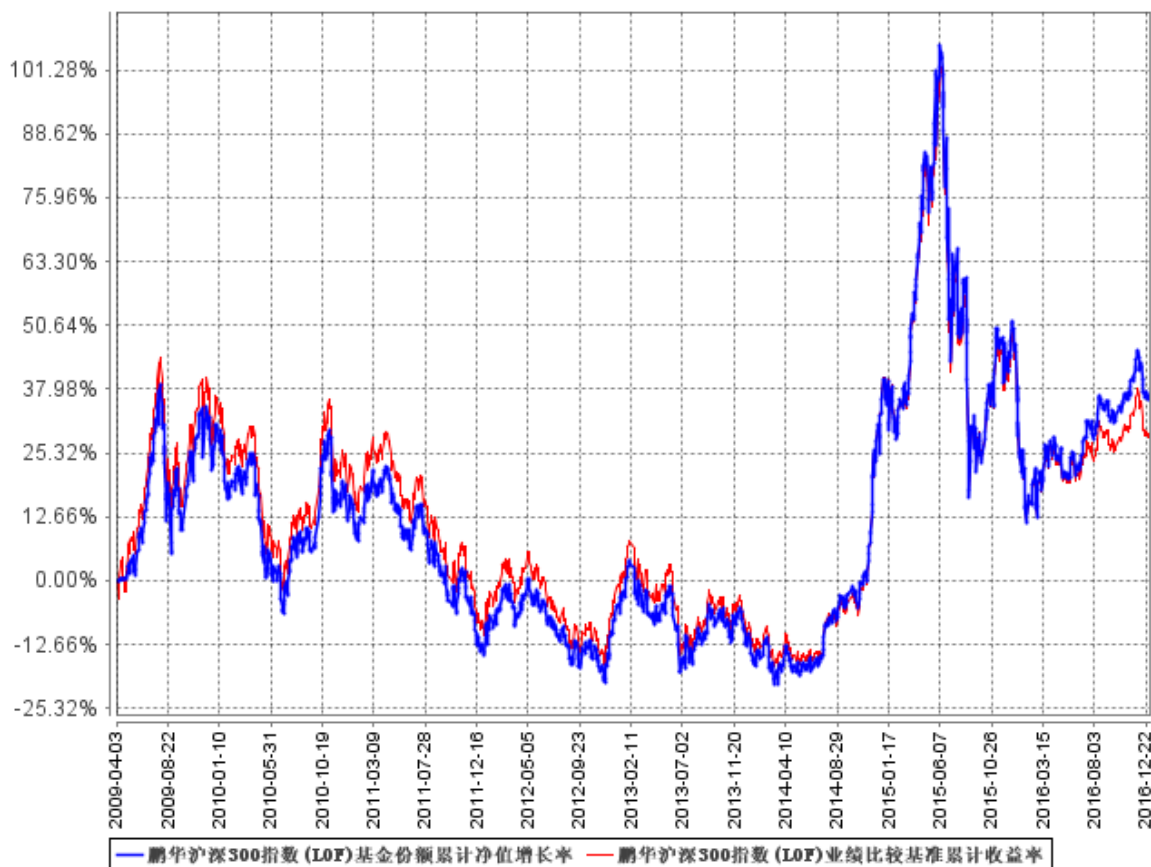
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.92%	0.67%	1.67%	0.67%	1.25%	0.00%

注：业绩基准=沪深 300 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

鹏华沪深300指数(LOF)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 2009 年 4 月 3 日生效。

2、按基金合同规定，截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张羽翔	本基金基金经理	2016 年 9 月 24 日	-	9	张羽翔先生，国籍中国，工学硕士，9 年金融证券从业经验。曾任招商银行软件中心（原深圳市融博技术公司）数据分析师；2011 年 3 月加盟鹏华基金管理有限

					公司, 历任监察稽核部资深金融工程师、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 9 月起担任鹏华上证民企 50ETF 基金及其联接基金基金经理, 2016 年 6 月起兼任鹏华新丝路分级基金基金经理, 2016 年 7 月起兼任鹏华高铁产业分级基金基金经理, 2016 年 9 月起兼任鹏华中证 500 指数(LOF)、鹏华沪深 300 指数(LOF)基金基金经理, 2016 年 11 月起兼任鹏华一带一路分级、鹏华新能源分级基金基金经理。张羽翔先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
--	--	--	--	--	---

注: 1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日; 担任新成立基金基金经理的, 任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定, 本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内, 本基金运作合规, 不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内, 本基金管理人严格执行公平交易制度, 确保不同投资组合在研究、交易、分配各环节得到公平对待。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内, 本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内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 2 次, 主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，基金运作严格按照基金合同的各项要求，依据被动化指数投资方法进行投资管理。

报告期内，市场行情趋于稳定，投资管理操作正常开展。基金日均跟踪偏离度和跟踪误差都有较好的控制。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期末，基金份额净值为 1.303, 本报告期基金份额净值增长率为 2.92%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注：无

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	238,924,512.00	93.96
	其中：股票	238,924,512.00	93.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,275,765.66	6.01
8	其他资产	88,414.43	0.03
9	合计	254,288,692.09	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	705,586.96	0.28
B	采矿业	8,262,247.56	3.26
C	制造业	77,550,765.30	30.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,478,639.02	2.56
E	建筑业	10,941,024.57	4.32

F	批发和零售业	5,160,389.64	2.04
G	交通运输、仓储和邮政业	6,848,487.27	2.70
H	住宿和餐饮业	120,786.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,516,357.71	6.12
J	金融业	84,013,846.61	33.14
K	房地产业	12,359,205.25	4.88
L	租赁和商务服务业	2,742,427.77	1.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,874,155.15	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	311,468.30	0.12
R	文化、体育和娱乐业	3,279,064.17	1.29
S	综合	1,104,532.68	0.44
	合计	237,268,983.96	93.60

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	804,097.70	0.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.01
E	建筑业	247,657.23	0.10
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	233,856.77	0.09
J	金融业	322,540.00	0.13
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	1,655,528.04	0.65
--	----	--------------	------

### 5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	279,574	9,905,306.82	3.91
2	601166	兴业银行	344,352	5,557,841.28	2.19
3	600016	民生银行	610,462	5,542,994.96	2.19
4	600036	招商银行	266,332	4,687,443.20	1.85
5	600519	贵州茅台	13,018	4,349,964.70	1.72
6	601328	交通银行	709,451	4,093,532.27	1.61
7	600000	浦发银行	223,312	3,619,887.52	1.43
8	000002	万科A	175,032	3,596,907.60	1.42
9	601668	中国建筑	387,291	3,431,398.26	1.35
10	600837	海通证券	209,012	3,291,939.00	1.30

### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601611	中国核建	13,500	232,065.00	0.09
2	600996	贵广网络	12,083	227,039.57	0.09
3	002797	第一创业	6,200	215,760.00	0.09
4	603986	兆易创新	755	134,367.35	0.05
5	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.05

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-



	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

##### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

#### 1、海通证券

本基金投资的前十名证券之一海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）

于 2016 年 11 月 28 日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《行政处罚决定书》（[2016]127 号），主要内容如下：海通证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条，《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条，《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第(四)项，《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的信息进行审查和了解，违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为，获利 28,653,000 元。海通证券宁波百丈东路营业部在明知客户身份存疑的情况下为客户办理有关手续，并且向其他客户推介配资业务。海通证券杭州解放路营业部在 2015 年 4 月明知媒体已报道其客户疑似从事配资业务后，仍未采取有效措施规范该等账户。此外，在 2015 年 7 月 12 日我会发布《关于清理整顿违法从事证券业务活动的意见》（证监会公告[2015]19 号）之后，海通证券仍未采取有效措施严格审查客户身份的真实性，未切实防范客户借用证券交易通道违规从事交易活动，新增下未切实防范客户借用证券交易通道违规从事交易活动，新增下挂子账户 62 个，性质恶劣、情节严重。根据当事人违法行为的事实、性质、情节和社会危害程度，依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定，中国证监会决定：对海通证券责令改正，给予警告，没收违法所得 28,653,000 元，并处以 85,959,000 元罚款。

针对此案，公司已按照监管要求完成了整改；同时，公司对涉及此案所得和处罚金额已于 2015 年度全额计入损益，因此，本次《行政处罚决定书》对公司 2016 年及未来财务无重大影响。此案的了结，消除了公司面临的不确定性，有利于公司未来发展。

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。

本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，按照成份股权重进行配置该证券，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	8,921.31
2	应收证券清算款	58,829.62
3	应收股利	-
4	应收利息	2,960.01
5	应收申购款	17,703.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	88,414.43

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603986	兆易创新	134,367.35	0.05	重大事项

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	198,143,356.89
报告期期间基金总申购份额	9,958,362.14
减：报告期期间基金总赎回份额	13,480,362.64
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	194,621,356.39

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:截止本报告期末,本基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金管理人本报告期末申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

注:无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》;
- (二) 《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》;
- (三) 《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2016 年第 4 季度报告》 (原文)。

### 9.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行股份有限公司

### 9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站 (<http://www.phfund.com.cn>) 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  
2017 年 1 月 19 日