

鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金 2016 年年度报告摘要

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 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 2017 年 3 月 27 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 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华环保分级		
场内简称	环保分级		
基金主代码	160634		
交易代码	160634		
前端交易代码	-		
后端交易代码	-		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 6 月 16 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	160,390,020.48 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 年 6 月 26 日		
下属分级基金的基金简称	鹏华环保分级	鹏华环保 A	鹏华环保 B
下属分级基金的场内简称	环保分级	环保 A 级	环保 B 级
下属分级基金的交易代码	160634	150237	150238
报告期末下属分级基金份额总额	142,811,048.48 份	8,789,486.00 份	8,789,486.00 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>本基金力争鹏华环保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，以保证鹏华环保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>
--	--

	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。		
业绩比较基准	中证环保产业指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。		
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。	鹏华环保A份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征。	鹏华环保B份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。

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基金管理人互联网网址	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	2016 年	2015 年 6 月 16 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-19,641,080.27	-63,601,065.41
本期利润	-32,569,699.60	-71,145,038.62
加权平均基金份额本期利润	-0.1774	-0.2447
本期基金份额净值增长率	-13.03%	-14.34%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3717	-0.2623
期末基金资产净值	174,157,835.99	247,121,666.90
期末基金份额净值	1.086	1.279

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 2015 年 6 月 16 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

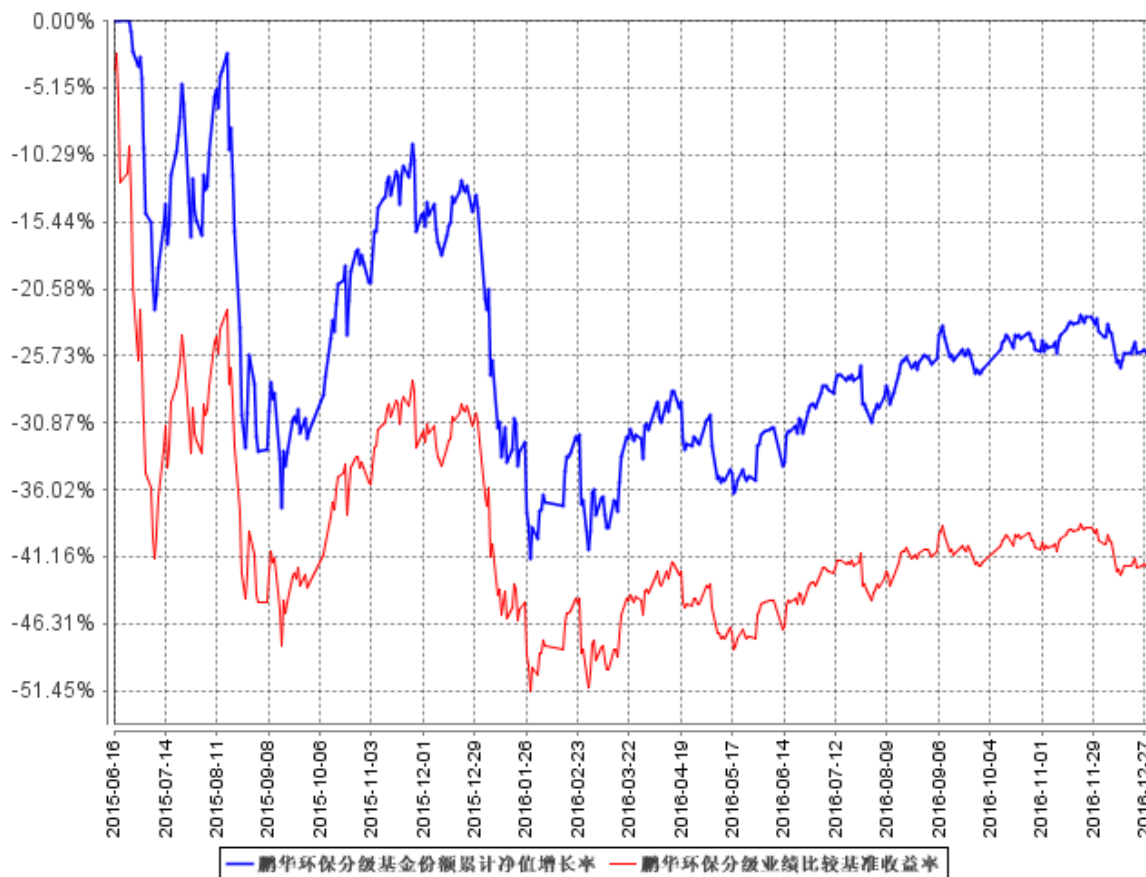
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.68%	0.77%	-0.78%	0.81%	2.46%	-0.04%
过去六个月	5.64%	0.89%	1.95%	0.91%	3.69%	-0.02%
过去一年	-13.03%	1.89%	-16.18%	1.81%	3.15%	0.08%
自基金合同生效起至今	-25.50%	2.34%	-41.98%	2.41%	16.48%	-0.07%

注：业绩比较基准=中证环保产业指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鹏华环保分级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

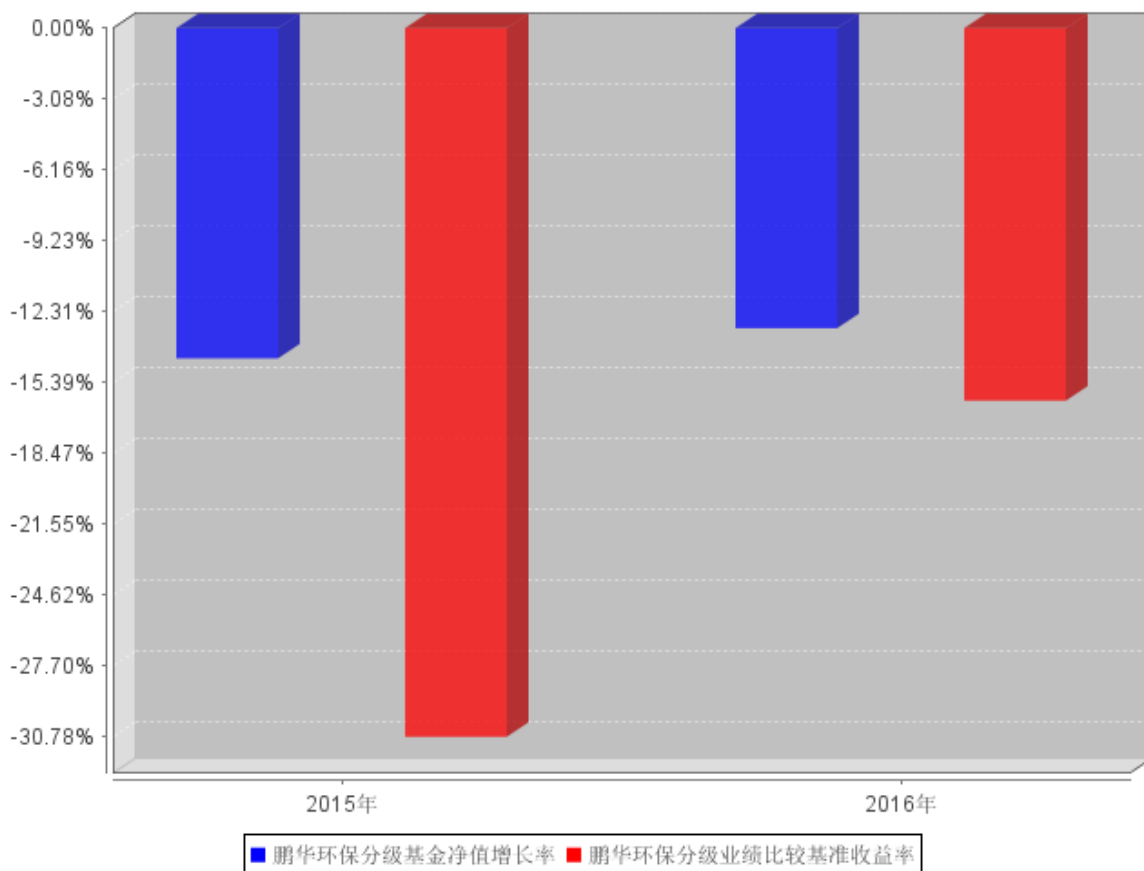


注：1、本基金基金合同于 2015 年 6 月 16 日生效。

2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 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

鹏华环保分级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 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同于 2015 年 6 月 16 日生效。根据本基金基金合同约定，在存续期内，本基金（包括鹏华环保份额、鹏华环保 A 份额、鹏华环保 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 129 只基金和 10 只全国社保投资组合，经过 18 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		
余斌	本基金基金经理	2015 年 6 月 16 日	-	9	余斌先生，国籍中国，经济学硕士，9 年证券从业经验。曾任职于招商证券股份有限公司，担任风险控制部市场风险分析师；2009 年 10 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任机构理财部大客户经理、量化投资部量化研究员，先后从事特定客户资产管理业务产品设计、量化研究等工作；2014 年 5 月起担任鹏华信息分级基金基金经理，2014 年 5 月起兼任鹏华证券保险分级基金基金经理，2014 年 11 月起兼任鹏华国防分级基金基金经理，2015 年 4 月起兼任鹏华酒分级基金基金经理，2015 年 5 月起兼任鹏华证券分级基金基金经理，2015 年 6 月起兼任鹏华环保分级基金基金经理。余斌先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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并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 4 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

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末，基金份额净值为 1.086，累计净值为 0.745。本报告期基金份额净值增长率为 -13.03%。

报告期内，本基金日均跟踪偏离度的绝对值为 0.08%，年化跟踪误差为 1.9%，均符合基金合同的相关要求。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年宏观经济环境相对 2016 年有三个方面的变化。一、预期经济增速有所下调，政府和市场对当期经济所面临的深层次矛盾和问题有着充分认识，经济增长的内生动力不足，金融风险有所积聚，“控风险、调结构”仍然摆在经济工作的突出位置；二、首次提出稳健中性的货币政策基调，在流动性基本稳定的前提下，货币政策的工具和实施将可能出现新的重要变化。三、2017 年是供给侧结构性改革的深化之年，围绕着“三去一降一补”和深化国有企业改革，有望减轻企业的经营包袱和提高经营效率，部分行业的集中度可能快速提升。

此外，2017 年外部经济和政治环境也存在较多的不确定性，人民币的贬值压力仍未解除。尽管流动性会保持稳定，但已一改过去宽松格局。在目前市场环境下，投资者风险偏好较难快速改善，投资者更应积极把握市场的结构性投资机会。

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

根据本基金基金合同约定，在存续期内，本基金（包括鹏华环保分级份额、鹏华环保 A 级份额、鹏华环保 B 级份额）不进行收益分配。

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：鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		9,656,254.02	12,155,606.40
结算备付金		13,096.38	1,677,083.03
存出保证金		19,564.30	291,746.31
交易性金融资产		165,623,320.58	234,160,133.24
其中：股票投资		165,623,320.58	234,160,133.24
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		58,819.91	1,016,708.59
应收利息		2,194.83	4,219.14
应收股利		-	-
应收申购款		16,455.78	125,128.85
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		175,389,705.80	249,430,625.56
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 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		401,571.84	1,282,874.39
应付管理人报酬		160,181.54	228,602.73
应付托管费		35,239.95	50,292.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		123,494.07	492,399.44
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		511,382.41	254,789.49
负债合计		1,231,869.81	2,308,958.66
所有者权益：			
实收基金		233,775,587.09	288,383,483.21
未分配利润		-59,617,751.10	-41,261,816.31
所有者权益合计		174,157,835.99	247,121,666.90
负债和所有者权益总计		175,389,705.80	249,430,625.56

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，鹏华环保级份额净值 1.086 元，鹏华环保 A 份额净值 1.008 元，鹏华环保 B 份额净值 1.164 元；基金份额总额 160,390,020.48 份，其中鹏华环保分级份额 142,811,048.48 份，鹏华环保 A 份额 8,789,486.00 份，鹏华环保 B 份额 8,789,486.00 份。

7.2 利润表

会计主体：鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 16 日(基金 合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-29,098,870.40	-67,246,427.87
1.利息收入		89,934.09	315,035.10
其中：存款利息收入		89,934.09	315,035.10
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-16,418,359.81	-60,675,468.29
其中：股票投资收益		-17,852,279.53	-61,126,107.82
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		1,433,919.72	450,639.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-12,928,619.33	-7,543,973.21
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		158,174.65	657,978.53
减：二、费用		3,470,829.20	3,898,610.75
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	1,938,804.75	1,563,327.10
2. 托管费	7.4.8.2.2	426,537.01	343,931.94
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		485,816.35	1,612,142.31
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		619,671.09	379,209.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-32,569,699.60	-71,145,038.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-32,569,699.60	-71,145,038.62

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	288,383,483.21	-41,261,816.31	247,121,666.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-32,569,699.60	-32,569,699.60
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）	-54,607,896.12	14,213,764.81	-40,394,131.31

其中：1. 基金申购款	127,263,339.92	-36,106,679.33	91,156,660.59
2. 基金赎回款	-181,871,236.04	50,320,444.14	-131,550,791.90
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）	233,775,587.09	-59,617,751.10	174,157,835.99
项目	上年度可比期间 2015年6月16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）	479,082,437.20	-	479,082,437.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-71,145,038.62	-71,145,038.62
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）	-190,698,953.99	29,883,222.31	-160,815,731.68
其中：1. 基金申购款	423,826,563.62	-59,095,833.42	364,730,730.20
2. 基金赎回款	-614,525,517.61	88,979,055.73	-525,546,461.88
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）	288,383,483.21	-41,261,816.31	247,121,666.90

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

高鹏

郝文高

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

鹏华中证环保产业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 506 号《关于准予鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金注册的批复》准予,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《鹏华中证环保产业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 478,984,427.03 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 772 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 479,082,437.20 份基金份额，其中认购资金利息折合 98,010.17 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《鹏华中证环保产业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环保产业指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“鹏华环保份额”)、鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金之 A 份额(以下简称“鹏华环保 A 份额”)、鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金之 B 份额(以下简称“鹏华环保 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。鹏华环保份额为可以申购、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。鹏华环保 A 份额与鹏华环保 B 份额为可以上市交易但不能申购、赎回的基金份额，其中鹏华环保 A 份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的风险收益特征，鹏华环保 B 份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的风险收益特征。鹏华环保 A 份额与鹏华环保 B 份额的配比始终保持 1:1 的比率不变。本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环保份额；场内认购的份额将按照 1:1 的比例确认为鹏华环保 A 份额与鹏华环保 B 份额。本基金基金合同生效后，鹏华环保份额与鹏华环保 A 份额、鹏华环保 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环保份额按照 2 份鹏华环保份额对应 1 份鹏华环保 A 份额与 1 份鹏华环保 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环保 A 份额与鹏华环保 B 份额按照 1 份鹏华环保 A 份额与 1 份鹏华环保 B 份额对应 2 份鹏华环保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：鹏华环保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环保份额、鹏华环保 A 份额、鹏华环保 B 份额的份额数之和。鹏华环保 A 份额的基金份额净值为鹏华环保 A 份额的本金及约定应得收益之和。每 2 份鹏华环保份额所对应的基金资产净值等于 1 份鹏华环保 A 份额与 1 份鹏华环保 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。在鹏华环保 A 份额、鹏华环保份额存续期内的每个会计年度 11 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，鹏华环保 A

份额与鹏华环保 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于鹏华环保 A 份额的约定应得收益,即鹏华环保 A 份额每个会计年度 10 月 31 日基金份额参考净值超出 1.000 元部分,将折算为场内鹏华环保份额分配给鹏华环保 A 份额持有人。鹏华环保份额持有人持有的每 2 份鹏华环保份额将按 1 份鹏华环保 A 份额获得新增鹏华环保份额的分配。持有场外鹏华环保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环保份额的分配;持有场内鹏华环保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环保份额的分配。经过上述份额折算,鹏华环保 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元,鹏华环保份额的基金份额净值将相应调整。

除定期份额折算外,本基金还将在鹏华环保份额的基金份额净值达到 1.500 元时或鹏华环保 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环保份额、鹏华环保 A 份额、鹏华环保 B 份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保鹏华环保 A 份额与鹏华环保 B 份额的比例为 1:1,份额折算后鹏华环保份额的基金份额净值、鹏华环保 A 份额与鹏华环保 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 291 号文审核同意,本基金鹏华环保 A 份额 109,870,294.00 份基金份额和鹏华环保 B 份额 109,870,294.00 份基金份额于 2015 年 6 月 26 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的鹏华环保份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其分拆为鹏华环保 A 份额和鹏华环保 B 份额即可上市流通;对于托管在场外的鹏华环保份额,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环保 A 份额和鹏华环保 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《鹏华中证环保产业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:中证环保产业指数收益率 \times 95%+商业银行活期存款利率(税后) \times 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》、《鹏华中证环保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 2016 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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 会计政策变更的说明

无。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前, 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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起, 金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税, 对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

2017 年 7 月 1 日(含)以后, 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人, 按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生

的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此，截至 2016 年 12 月 31 日，本基金没有计提有关增值税费用。

(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，股票的股息、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，应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。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，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

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年6月16日(基金合同生效日)至 2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
国信证券	72,438,216.18	23.36%	98,258,798.73	8.36%

7.4.8.1.2 债券交易

注：无。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.8.1.4 权证交易

注：无。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国信证券	66,012.88	23.36%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年6月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国信证券	88,369.44	8.36%	46,103.68	9.36%

注：（1）佣金的计算公式：

上海证券交易所的交易佣金=买（卖）成交金额×1%-买（卖）经手费-买（卖）证管费

深圳证券交易所的交易佣金=买（卖）成交金额×1%-买（卖）经手费-买（卖）证管费（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

（2）本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年6月16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	1,938,804.75	1,563,327.10
其中：支付销售机构的客户维护费	576,673.50	394,572.85

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年6月16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	426,537.01	343,931.94

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费年费率为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。

7.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

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

注：无。

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未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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年6月16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	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	9,656,254.02	83,518.66	12,155,606.40	304,636.27

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2016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

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	2,544	54,187.20	54,187.20	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	1,985	20,723.40	20,723.40	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-

603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	23.16	23.16	831	19,245.96	19,245.96	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

注：截至本报告期末，本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限的债券和权证。

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
603169	兰石重装	2016年11月24日	重大事项	13.36	2017年3月21日	14.32	155,300	2,559,741.21	2,074,808.00	-
600151	航天机电	2016年11月11日	重大事项	10.97	-	-	184,000	2,423,659.61	2,018,480.00	-
601727	上海电气	2016年8月31日	重大事项	8.42	-	-	239,538	2,737,309.46	2,016,909.96	-
600875	东方电气	2016年12月9日	重大事项	10.79	2017年3月28日	10.90	173,200	2,312,446.33	1,868,828.00	-
002335	科华恒盛	2016年12月16日	重大事项	42.90	2017年3月27日	43.10	42,700	1,796,672.09	1,831,830.00	-
600406	国电南瑞	2016年12月29日	重大事项	16.63	-	-	106,800	1,750,307.12	1,776,084.00	-
603308	应流股份	2016年11月24日	重大事项	21.92	2017年2月14日	21.92	68,400	1,668,076.03	1,499,328.00	-
002129	中环股	2016年4月	重大事	9.20	-	-	156,300	2,244,210.22	1,437,960.00	-

	份	25 日	项						
--	---	------	---	--	--	--	--	--	--

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	165,623,320.58	94.43
	其中：股票	165,623,320.58	94.43
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	9,669,350.40	5.51
7	其他各项资产	97,034.82	0.06
8	合计	175,389,705.80	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	110,262,321.85	63.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,285,628.72	13.37
E	建筑业	9,766,754.25	5.61
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,453,748.00	3.71
J	金融业	1,715,057.92	0.98
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,717,816.00	0.99
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,807,520.41	5.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	1,633,716.45	0.94
	合计	164,642,563.60	94.54

8.2.2 期末积极投资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	631,962.07	0.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.02
E	建筑业	15,592.23	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.01

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	179,046.34	0.10
J	金融业	106,780.00	0.06
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	980,756.98	0.56

8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	603169	兰石重装	155,300	2,074,808.00	1.19
2	600151	航天机电	184,000	2,018,480.00	1.16
3	601727	上海电气	239,538	2,016,909.96	1.16
4	000939	凯迪生态	152,800	1,966,536.00	1.13
5	600416	湘电股份	129,900	1,910,829.00	1.10
6	600875	东方电气	173,200	1,868,828.00	1.07
7	600481	双良节能	245,500	1,846,160.00	1.06
8	000400	许继电气	101,100	1,834,965.00	1.05
9	002335	科华恒盛	42,700	1,831,830.00	1.05
10	000690	宝新能源	197,200	1,828,044.00	1.05

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。

8.3.2 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前五名股票投资明细

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	600996	贵广网络	9,166	172,229.14	0.10
2	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.07
3	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.06
4	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.04
5	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.04

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	300316	晶盛机电	3,572,671.58	1.45
2	300269	联建光电	2,588,427.82	1.05
3	002531	天顺风能	2,570,040.19	1.04
4	002610	爱康科技	2,465,861.50	1.00
5	000601	韶能股份	2,379,246.88	0.96
6	300197	铁汉生态	2,280,966.84	0.92
7	300266	兴源环境	2,166,393.90	0.88
8	002180	艾派克	2,086,944.50	0.84
9	603588	高能环境	2,045,520.80	0.83
10	002203	海亮股份	1,968,662.00	0.80
11	603308	应流股份	1,944,662.00	0.79
12	300118	东方日升	1,917,108.00	0.78
13	600590	泰豪科技	1,916,857.00	0.78
14	600401	海润光伏	1,895,148.00	0.77
15	002518	科士达	1,883,616.00	0.76

16	300484	蓝海华腾	1,857,795.20	0.75
17	002080	中材科技	1,840,835.00	0.74
18	002717	岭南园林	1,823,054.00	0.74
19	002335	科华恒盛	1,796,672.09	0.73
20	601127	小康股份	1,712,282.70	0.69

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 累计卖出金额超初期基金资产净值 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	300072	三聚环保	3,240,924.78	1.31
2	000035	中国天楹	3,135,997.88	1.27
3	002384	东山精密	3,081,064.80	1.25
4	000652	泰达股份	2,990,347.00	1.21
5	002479	富春环保	2,965,117.00	1.20
6	600261	阳光照明	2,895,134.77	1.17
7	601158	重庆水务	2,891,883.00	1.17
8	300296	利亚德	2,791,995.03	1.13
9	002180	艾派克	2,786,225.18	1.13
10	002531	天顺风能	2,733,756.38	1.11
11	603699	纽威股份	2,668,361.86	1.08
12	601179	中国西电	2,665,265.00	1.08
13	601106	中国一重	2,608,590.03	1.06
14	600550	保变电气	2,584,673.97	1.05
15	002005	德豪润达	2,530,721.00	1.02
16	603686	龙马环卫	2,513,789.04	1.02
17	300355	蒙草生态	2,472,250.00	1.00
18	002131	利欧股份	2,345,716.86	0.95
19	600168	武汉控股	2,217,867.99	0.90
20	600236	桂冠电力	2,201,362.38	0.89

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	137,911,334.58
卖出股票收入（成交）总额	175,667,248.38

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前十名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

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

8.11.2 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

注：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

1、凯迪生态

本组合投资的前十名证券之一凯迪生态环境科技股份有限公司（以下简称“凯迪生态”）于 2016 年 7 月 29 日收到了中国证券监督管理委员会湖北证监局（以下简称“湖北证监局”）对公司下达的《湖北证监局关于对李林芝、陈义生、张鸿健采取监管谈话措施的决定》（[2016]11 号）、《湖北证监局关于对凯迪生态环境科技股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（[2016]12 号）。决定书主要内容为：“经查，我局发现凯迪生态关联方武汉金湖科技有限公司（以下简称金湖科技）与凯迪生态大股东阳光凯迪新能源集团有限公司（以下简称阳光凯迪）在人员、资金方面存在特殊关系。公司未及时准确披露与金湖科技的关联关系。公司 2015 年年报披露的财务总监仍为汪军，未披露其离职信息。2016 年 3 月 25 日，公司向审计机构提供未审报表，显示归属于母公司所有者的利润为 4.08 亿元。但直到 2016 年 4 月 26 日（2015 年年报披露前一日），公司才披露业绩预告修正公告。公司上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》第二条、第二十一条的规定。按照《上市公司信息披露管理办法》第五十八条的规定，李林芝、陈义生、张鸿健三人作为凯迪生态的董事长、总经理和董事会秘书，要求三人于 2016 年 8 月 5 日 9 时携带有效身份证件到我局接受监管谈话。按照《上市公司信息披露管理办法》第五十九条的规定，现决定对你公司采取出具警示函的监管措施，你公司应针对上述违法违规行为，深刻反思信息披露、内部控制制度建设及执行中存在的问题和不足，采取切实可行的措施进行认真整改，进一步提高信息披露意识和规范运作水平”。

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凯迪生态，认为本次行政处罚对该证券的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，按照成份股权重进行配置该证券，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

2、兰石重装

本组合投资的前十名证券之一兰石重型装备股份有限公司（以下简称“兰石重装”）接到持股 5%以上股东金石投资有限公司（以下简称“金石投资”）的通知，金石投资于 2016 年 8 月 31 日通过上海证券交易所交易系统减持公司股份时，因工作人员操作失误，误将卖出指令输入为买入指令，并实现交易，导致出现了《中华人民共和国证券法》（以下简称“证券法”）第 47 条所规定的短线交易情形，造成违规买卖公司股票的行为。本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。金石投资于 2016 年 8 月 31 日减持公司股份的过程中，由于工作人员的误操作，误将卖出键点击为买入键，通过上海证券交易所交易系统买入公司股份 2,200 股，该股票买卖行为构成了短线交易行为。金石投资的上述行为尽管属于工作人员粗心疏忽、操作失误所致，但客观上造成违反了《证券法》第 47 条的有关规定。经公司自查，上述交易未在公司披露定期报告的敏感期内，公司无影响证券价格的重大信息，亦不存在因获悉内幕信息而交易公司股票的情形。根据金石投资提供的相关资料，本次金石投资因误操作买入公司股票，不存在利用内幕信息进行交易谋求利益的目的。

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兰石重装，认为本次行政处罚对该证券的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，按照成份股权重进行配置该证券，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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	19,564.30
2	应收证券清算款	58,819.91
3	应收股利	-
4	应收利息	2,194.83
5	应收申购款	16,455.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	97,034.82

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 期末前十名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	603169	兰石重装	2,074,808.00	1.19	重大事项
2	600151	航天机电	2,018,480.00	1.16	重大事项
3	601727	上海电气	2,016,909.96	1.16	重大事项
4	600875	东方电气	1,868,828.00	1.07	重大事项
5	002335	科华恒盛	1,831,830.00	1.05	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

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	601375	中原证券	106,780.00	0.06	新股锁定

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

份额级别	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
鹏华环保分级	7,011	20,369.57	158,889.35	0.11%	142,652,159.13	99.89%
鹏华环保A	298	29,494.92	2,227,292.00	25.34%	6,562,194.00	74.66%
鹏华环保B	579	15,180.46	1,443,001.00	16.42%	7,346,485.00	83.58%

合计	7,888	20,333.42	3,829,182.35	2.39%	156,560,838.13	97.61%
----	-------	-----------	--------------	-------	----------------	--------

9.2 期末上市基金前十名持有人

鹏华环保分级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	李浩恒	3,430,383.00	16.52%
2	郎智君	2,735,968.00	13.18%
3	席珍	823,259.00	3.96%
4	王彩兰	480,230.00	2.31%
5	黄翠萍	343,041.00	1.65%
6	郭淑敏	343,021.00	1.65%
7	李艳珍	343,014.00	1.65%
8	郭燕丽	343,014.00	1.65%
9	张小红	258,651.00	1.25%
10	温学会	212,671.00	1.02%

鹏华环保 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	李怡名	2,447,756.00	27.85%
2	华夏未来资本管理有限公司—华夏未来添时 6 号私募证券投资基金	611,836.00	6.96%
3	上海明泐投资管理有限公司—明泐稳健增长 2 期私募投资基金	604,133.00	6.87%
4	上海明泐投资管理有限公司—明泐全天候一号基金	451,263.00	5.13%
5	丁碧霞	450,000.00	5.12%
6	中国对外经济贸易信托有限公司—外贸信托—华夏未来泽时进取 6	173,516.00	1.97%
7	谭惠贞	167,451.00	1.91%
8	华夏未来资本管理有限公司—华夏未来添时 2 号基金	148,021.00	1.68%
9	王爱国	121,168.00	1.38%
10	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	114,000.00	1.30%

鹏华环保 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	李怡名	650,000.00	7.40%
2	上海明泐投资管理有限公司—明泐	604,133.00	6.87%

	稳健增长 2 期私募投资基金		
3	上海明法投资管理有限公司—明法全天候一号基金	451,263.00	5.13%
4	丁碧霞	450,000.00	5.12%
5	邹璞如	323,464.00	3.68%
6	上海申毅投资股份有限公司—申毅多策略量化套利 7 号	273,101.00	3.11%
7	谭惠贞	167,451.00	1.91%
8	陈志伟	157,755.00	1.79%
9	许中云	150,000.00	1.71%
10	郑凯鹏	142,400.00	1.62%

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

注：截止本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

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：截止本报告期末，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未持有本基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华环保分级	鹏华环保 A	鹏华环保 B
基金合同生效日（2015 年 6 月 16 日）基金份额总额	259,341,849.20	109,870,294.00	109,870,294.00
本报告期期初基金份额总额	165,582,497.83	13,787,275.00	13,787,275.00
本报告期基金总申购份额	85,336,153.65	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	123,037,352.36	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	14,929,749.36	-4,997,789.00	-4,997,789.00
本报告期期末基金份额总额	142,811,048.48	8,789,486.00	8,789,486.00

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

报告期内基金管理人的重大人事变动：

报告期内，因股东方更换董事代表，原董事 Alessandro Varaldo 先生不再担任公司董事职务。根据股东欧利盛资本资产管理股份公司推荐，并经本公司股东会审议通过，同意由 Andrea Vismara 先生担任本公司董事，Alessandro Varaldo 先生不再担任本公司董事职务。Andrea Vismara 先生任职日期自 2016 年 2 月 2 日起。

报告期内，原监事 Andrea Vismara 先生辞去公司监事职务。根据股东欧利盛资本资产管理股份公司推荐，并经本公司股东会审议通过，同意由 Sandro Vesprini 先生担任本公司监事，Andrea Vismara 先生不再担任本公司监事职务。Sandro Vesprini 先生任职日期自 2016 年 2 月 2 日起。

经公司董事会审议通过，公司同意聘任韩亚庆先生担任公司副总经理。韩亚庆先生任职日期自 2017 年 3 月 22 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

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 50,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的年限为 2 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	
安信证券	2	76,422,382.62	24.64%	69,645.24	24.64%	-
国信证券	2	72,438,216.18	23.36%	66,012.88	23.36%	本报告期内新增1个
长江证券	1	54,089,969.34	17.44%	49,292.10	17.44%	-
中信建投	2	49,810,546.22	16.06%	45,392.65	16.06%	-
中金公司	2	23,165,142.68	7.47%	21,110.93	7.47%	本报告期内新增1个
天风证券	1	16,782,266.63	5.41%	15,287.75	5.41%	本报告期内新增
中泰证券	2	11,776,316.28	3.80%	10,731.74	3.80%	-
广发证券	1	4,008,147.49	1.29%	3,652.52	1.29%	-
平安证券	2	1,335,507.00	0.43%	1,217.07	0.43%	-
招商证券	1	322,813.00	0.10%	294.15	0.10%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	本报告期内新增
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
宏源证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	本报告期内新增1个
国金证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
东方财富证券	1	-	-	-	-	本报告期内

						新增
德邦证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
方正证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
中航证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

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

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
安信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

鹏华基金管理有限公司
2017年3月30日