

鹏华中证传媒指数分级证券投资基金 2015 年半年度报告

2015年6月30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：2015年8月25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。本半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 2015 年 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3 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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 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.....	41
7.7 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.....	41
7.8 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.....	42
7.9 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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42

§8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.4 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.....	45
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
10.2 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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	48
§11 备查文件目录	57
11.1 备查文件目录.....	57
11.2 存放地点.....	57
11.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证传媒指数分级证券投资基金		
基金简称	鹏华传媒分级		
场内简称	传媒分级		
基金主代码	160629		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014 年 12 月 11 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, 271, 332, 539. 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	2014-12-22		
下属分级基金的基金简称	传媒分级	传媒分级 A	传媒分级 B
下属分级基金场内简称:	传媒分级	传媒 A	传媒 B
下属分级基金的交易代码	160629	150203	150204
报告期末下属分级基金份额总额	1, 019, 283, 187. 48 份	626, 024, 676. 00 份	626, 024, 676. 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>本基金力争鹏华传媒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</p>
业绩比较基准	中证传媒指数收益率×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。	鹏华传媒 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。	鹏华传媒 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
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	北京市西城区金融街 25 号
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		何如	王洪章

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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层鹏华基金管理有限公司 北京市西城区金融大街 25 号中国建设银行股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	527,314,982.47
本期利润	600,358,815.34
加权平均基金份额本期利润	0.3363
本期加权平均净值利润率	28.27%
本期基金份额净值增长率	67.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	530,297,181.11
期末可供分配基金份额利润	0.2335
期末基金资产净值	2,325,661,573.95
期末基金份额净值	1.024
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	60.67%

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 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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

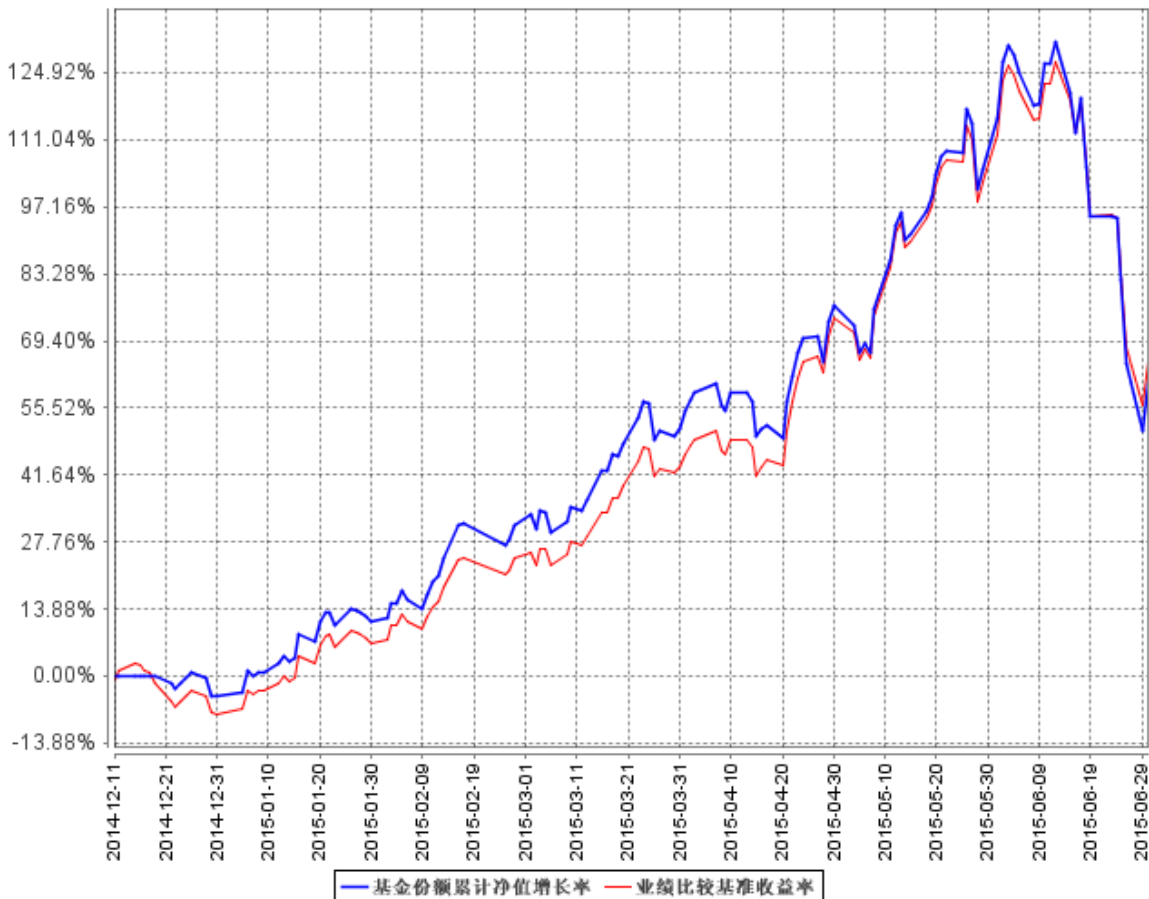
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-21.65%	4.61%	-18.35%	4.15%	-3.30%	0.46%
过去三个月	6.22%	3.55%	15.27%	3.28%	-9.05%	0.27%

过去六个月	67.72%	2.96%	78.92%	2.71%	-11.20%	0.25%
自基金合同生效起至今	60.67%	2.83%	65.10%	2.64%	-4.43%	0.19%

注：业绩比较基准=中证传媒指数收益率×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 2014 年 12 月 11 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。

§ 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，公司管理资产总规模达到 3575.13 亿元，管理 81 只开放式基金、10 只全国社保投资组合。经过近 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的经验。

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		
崔俊杰	本基金基金经理	2014 年 12 月 11 日	-	7	崔俊杰先生，国籍中国，金融工程专业管理学硕士，7 年证券投资基金从业经验。2008 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任产品规划部产品设计师、量化投资部量化研究员，先后从事产品设计、量化研究工作，2013 年 3 月起担任鹏华深证民营 ETF 基金及其联接基金基金经理，2013 年 3 月起兼任鹏华上证民企 50ETF 基金及其联接基金基金经理，2013 年 7 月起兼任鹏华沪深 300ETF 基金基金经理，2014 年 12 月起兼任鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金基金经理，2014 年 12 月起兼任鹏华中证传媒指数分级证券投资基金基金经理，2015 年 4 月起兼任鹏华中证银行指数分级证券投资基金基金经理。崔俊杰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 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。本报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

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

2015 年上半年，整个 A 股市场呈现先扬后抑的局面，6 月中下旬开始出现大幅回调。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，力争跟踪指数收益，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

2015 年上半年市场波动仍然较高，对基金的管理运作带来一定影响，面临这种情况，我们进行了精心的管理，较好的实现了跟踪误差控制目标。

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 1.024 元，累计净值 1.593 元，传媒 A 净值为 1.015 元，传媒 B 净值为 1.033 元。本报告期基金份额净值增长率为 67.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体来看，2015 年以来，虽然经济总量增速略微下调，但刺激政策频发，深化国企改革，一带一路稳步推进，房地产松绑政策推出，稳保就业底线，同时“新经济”、“新常态”已经逐渐得到大家的接受和认可。本质来讲，调结构与稳增长很难并行，若不破旧立新，经济结构的调整很难到位，“新经济”、“新常态”将两者很好阐释和结合起来。促进改革、稳定增长和防范风险三者涵盖了中国经济的短期和长期、速度和效益之间的辩证关系，我们不可能只要长期不要短期，只要效益不要速度，因此我们预期在经济增长相对稳定之中，加快推动结构的调整，随着改革红利逐步释放，生产效率的逐渐提升，势必能改变经济潜在下沉的局面。

2015 年宏观经济面临的问题较多，诸如货币政策的松紧，人民币汇率的弹性控制，未来房地产市场能否企稳，经济增速保底下的刺激政策，国企改革顺利推进，企业 IPO 稳步推出等。这些问题及衍生的新问题的出现和解决将决定未来 A 股市场的走势，也许随着资金流动性的宽裕，降

息、降准预期的实现，大类资产配置向股市的转移，房地产市场逐步企稳，人民币的国际化稳步推进等政策和措施的逐步明朗，A 股市场整体估值将可能在未来一段时间继续提升。但在市场波动中尤其要注意参与力度和风险控制，因此，我们建议继续密切关注与实体经济相关的宏观数据变化和 policy 信息。

我们仍然强调前期的观点：反复的经济形势势必带来资产之间轮动演绎的复杂化和高频率化，资产配置犯错的概率和机会成本相对较高，建议投资者从中长期投资的角度来考虑战略资产配置，避免短期频繁操作带来的风险。

本基金将积极应对各种因素对指数跟踪效果带来的冲击，努力将跟踪误差控制在基金合同规定的范围内，力争为投资者带来较好的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 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

4.6.1.1 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。

4.6.1.2 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、债券不活跃市场报价等投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、债券研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

4.6.2 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。

4.6.3 本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 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

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

4.7.2 本基金本报告期内未进行利润分配。

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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证传媒指数分级证券投资基金
报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	180,509,732.78	44,116,905.71
结算备付金		8,331,411.98	-
存出保证金		1,276,881.52	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,210,341,052.31	656,558,738.09
其中：股票投资		2,210,341,052.31	656,558,738.09
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		51,322,613.48	-
应收利息	6.4.7.5	48,195.72	32,384.93
应收股利		-	-
应收申购款		7,180,237.49	41,201,510.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,459,010,125.28	741,909,539.25
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	34,774,238.57
应付赎回款		125,351,187.25	6,839,999.48
应付管理人报酬		2,916,502.18	289,964.42
应付托管费		641,630.49	63,792.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,548,585.14	612,663.27
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	890,646.27	37,341.69
负债合计		133,348,551.33	42,617,999.56
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,447,736,367.52	730,002,211.97
未分配利润	6.4.7.10	877,925,206.43	-30,710,672.28
所有者权益合计		2,325,661,573.95	699,291,539.69

负债和所有者权益总计		2,459,010,125.28	741,909,539.25
------------	--	------------------	----------------

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，鹏华传媒分级份额净值 1.024 元，鹏华传媒 A 份额净值 1.015 元，鹏华传媒 B 份额净值 1.033 元；基金份额总额 2,271,332,539.48 份，其中鹏华传媒分级份额 1,019,283,187.48 份，鹏华传媒 A 份额 626,024,676.00 份，鹏华传媒 B 份额 626,024,676.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证传媒指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		623,464,707.93
1.利息收入		700,843.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	700,843.59
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）		542,068,598.30
其中：股票投资收益	6.4.7.12	537,371,286.20
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	4,697,312.10
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	73,043,832.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,651,433.17
减：二、费用		23,105,892.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,333,881.78
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,273,454.04
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	10,056,834.97
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	441,721.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		600,358,815.34
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		600,358,815.34

本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 357,643,788.40 元，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(2014)第 767 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》于 2014 年 12 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 357,738,461.74 份基金份额，其中认购资金利息折合 94,673.34 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《鹏华中证传媒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传媒指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“基础份额”）、鹏华中证传媒指数分级证券投资基金之 A 份额（以下简称“A 份额”）、鹏华中证传媒指数分级证券投资基金之 B 份额（以下简称“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。基础份额为可以申购、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。A 份额与 B 份额为可以上市交易但不能申购、赎回的基金份额，其中 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，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。A 份额与 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基础份额；场内认购的份额将按照 1:1 的比例确认为 A 份额与 B 份额。本基金基金合同生效后，基础份额与 A 份额、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基础份额按照 2 份基础份额对应 1 份 A 份额与 1 份 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 A 份额与 B 份额按照 1 份 A 份额与 1 份 B 份额对应 2 份基础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：基础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基础份额、A 份额、B 份额的份额数之和。A 份额的基金份额净值为 A 份额的本金及约定应得收益之和。每 2 份基础份额所对应的基金资产净值等于 1 份 A 份额与 1 份 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 A 份额、基础份额存续期内的每个会计年度 12 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，A 份额与 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于 A 份额的约定应得收益，即 A 份额每个会计年度 11 月 30 日基金份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内基础份额分配给 A 份额持有人。基础份额持有人持有的每 2 份基础份额将按 1 份 A 份额获得新增基础份额的分配。持有场外基础份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外基础份额的分配；持有场内基础份额的基金份额持有人将按前述折算

方式获得新增场内基础份额的分配。经过上述份额折算，A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，基础份额的基金份额净值将相应调整。

除定期份额折算外，本基金还将在基础份额的基金份额净值达到 1.500 元时或 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，本基金将分别对基础份额、A 份额、B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保 A 份额与 B 份额的比例为 1:1，份额折算后基础份额的基金份额净值、A 份额与 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[2014]第 473 号文审核同意，本基金 A 份额 29,090,398.00 份基金份额和 B 份额 29,090,398.00 份基金份额于 2014 年 12 月 22 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的基础份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为传媒 A 份额和传媒 B 份额即可上市流通；对于托管在场外的基础份额，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传媒 A 份额和传媒 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《鹏华中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易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%。本基金业绩比较基准为：中证传媒指数 收益率 \times 95% + 商业银行活期存款利率（税后） \times 5%

6.4.2 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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年上半年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 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记帐本位币，除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 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。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(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。

6.4.4.4 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：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(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(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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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利得/(损失)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)。

6.4.4.9 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。

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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在存续期内，本基金（包括鹏华传媒份额、鹏华传媒 A 份额、鹏华传媒 B 份额）不进行收益分配。

2、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 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《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期没有发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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》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, 暂减按 25% 计入应纳税所得额。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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	180,509,732.78

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	180,509,732.78

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,164,384,930.66	2,210,341,052.31	45,956,121.65
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	2,164,384,930.66	2,210,341,052.31	45,956,121.65

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截止本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截止本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截止本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	43,872.02
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	3,749.10

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	574.60
合计	48,195.72

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：截止本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,548,585.14
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,548,585.14

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	468,754.18
预提费用	215,214.43
指数使用费	206,677.66
合计	890,646.27

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	730,002,211.97	730,002,211.97
本期申购	2,010,675,417.05	2,010,675,417.05
本期赎回(以“-”号填列)	-1,747,382,045.73	-1,747,382,045.73
2015年3月24日基金拆分/份额折算前	993,295,583.29	993,295,583.29
基金拆分/份额折算变动份额	565,247,959.95	-
本期申购	4,180,909,234.48	2,664,978,851.69
本期赎回(以“-”号填列)	-3,468,120,238.24	-2,210,538,067.46

本期末	2, 271, 332, 539. 48	1, 447, 736, 367. 52
-----	----------------------	----------------------

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金自 2014 年 11 月 24 日至 2014 年 12 月 5 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 357, 643, 788. 40 元。根据《鹏华中证传媒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 94, 673. 34 元在本基金成立后，折算为 94, 673. 34 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3、根据本基金的基金合同关于不定期份额折算的相关规定，当鹏华传媒基础份额的基金份额净值达到 1.500 元时，本基金将进行不定期份额折算。截至 2015 年 3 月 23 日，本基金鹏华传媒基础份额的基金份额净值为 1.534 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金以 2015 年 3 月 24 日为基准日办理不定期份额折算业务。2015 年 3 月 26 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传媒 A、鹏华传媒 B 份额的二级市场交易已于当日恢复。

6.4.7.10 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
上年度末	-956, 232. 49	-29, 754, 439. 79	-30, 710, 672. 28
本期利润	527, 314, 982. 47	73, 043, 832. 87	600, 358, 815. 34
本期基金份额交易产生的变动数	3, 938, 431. 13	304, 338, 632. 24	308, 277, 063. 37
其中：基金申购款	519, 497, 572. 73	1, 951, 710, 154. 73	2, 471, 207, 727. 46
基金赎回款	-515, 559, 141. 60	-1, 647, 371, 522. 49	-2, 162, 930, 664. 09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	530, 297, 181. 11	347, 628, 025. 32	877, 925, 206. 43

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	575, 670. 00
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	54, 709. 65
其他	70, 463. 94
合计	700, 843. 59

注：其他为结算保证金利息收入以及申购款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	3,037,809,553.13
减：卖出股票成本总额	2,500,438,266.93
买卖股票差价收入	537,371,286.20

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期没有发生债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期没有发生衍生工具收益的买卖权证差价收入。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,697,312.10
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,697,312.10

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	73,043,832.87
——股票投资	73,043,832.87
——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	73,043,832.87

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	6,755,945.82
转换费收入	895,487.35
合计	7,651,433.17

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	10,056,834.97
银行间市场交易费用	-
合计	10,056,834.97

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	36,695.94
信息披露费	148,765.71
上市年费	29,752.78
指数使用费	206,677.66
银行汇划费用	19,829.71
合计	441,721.80

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 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 2014 年 12 月 11 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国信证券	2,271,487,103.80	32.36%

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元发生债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元发生债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元发生权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30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	2,010,040.96	32.19%	437,768.39	12.34%

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）证管费等由券商承担的费用

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）证管费等由券商承担的费用

（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《证券交易单元租用协议》。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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,333,881.78
其中：支付销售机构的客户维护费	2,154,428.92

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,273,454.04

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0.22%，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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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：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。

6.4.10.5 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1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	180,509,732.78	575,670.00

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末未参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：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股票，也没有持有因认购新发或增发而流通受限的债券及权证。

6.4.12.2 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	备注
000793	华闻传媒	2015年5月26日	重大事项	16.89	-	-	4,032,460	58,972,745.87	68,108,249.40	-
000839	中信国安	2015年6月29日	重大事项	23.57	-	-	2,982,508	51,973,721.01	70,297,713.56	-
000917	电广传媒	2015年5月28日	重大事项	30.81	-	-	2,385,310	54,361,083.32	73,491,401.10	-
002238	天威视讯	2015年6月29日	重大事项	23.76	-	-	489,320	9,382,108.81	11,626,243.20	-
002712	思美传媒	2015年3月19日	重大事项	72.86	2015年7月31日	66.10	48,220	2,631,510.22	3,513,309.20	-
300113	顺网科技	2015年5月5日	重大事项	53.60	2015年8月6日	51.93	489,429	18,458,745.84	26,233,394.40	-
300291	华录	2015年6月	重大	37.76	2015年7月	34.65	1,100,636	36,619,952.18	41,560,015.36	-

	百纳	30 日	事项		13 日					
300383	光环 新网	2015 年 6 月 17 日	重大 事项	73.09	-	-	368,662	21,444,558.24	26,945,505.58	-
300392	腾信 股份	2015 年 6 月 30 日	重大 事项	133.74	2015 年 7 月 14 日	147.11	115,900	21,747,193.85	15,500,466.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金没有从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金没有从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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，将风险控制在可承受的范围之内。

6.4.13.2 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中国建设银行股份有限公司，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 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.3 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约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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	180,509,732.78	-	-	-	180,509,732.78
结算备付金	8,331,411.98	-	-	-	8,331,411.98
存出保证金	1,276,881.52	-	-	-	1,276,881.52
交易性金融资产	-	-	-	2,210,341,052.31	2,210,341,052.31
应收证券清算款	-	-	-	51,322,613.48	51,322,613.48
应收利息	-	-	-	48,195.72	48,195.72
应收申购款	-	-	-	7,180,237.49	7,180,237.49
资产总计	190,118,026.28	-	-	2,268,892,099.00	2,459,010,125.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	125,351,187.25	125,351,187.25
应付管理人报酬	-	-	-	2,916,502.18	2,916,502.18
应付托管费	-	-	-	641,630.49	641,630.49
应付交易费用	-	-	-	3,548,585.14	3,548,585.14
其他负债	-	-	-	890,646.27	890,646.27
负债总计	-	-	-	133,348,551.33	133,348,551.33
利率敏感度缺口	190,118,026.28	-	-	2,135,543,547.67	2,325,661,573.95
上年度末 2014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	44,116,905.71	-	-	-	44,116,905.71
交易性金融资产	-	-	-	656,558,738.09	656,558,738.09
应收利息	-	-	-	32,384.93	32,384.93
应收申购款	-	-	-	41,201,510.52	41,201,510.52
资产总计	44,116,905.71	-	-	697,792,633.54	741,909,539.25
负债					
应付证券清算款	-	-	-	34,774,238.57	34,774,238.57
应付赎回款	-	-	-	6,839,999.48	6,839,999.48
应付管理人报酬	-	-	-	289,964.42	289,964.42
应付托管费	-	-	-	63,792.13	63,792.13
应付交易费用	-	-	-	612,663.27	612,663.27
其他负债	-	-	-	37,341.69	37,341.69
负债总计	-	-	-	42,617,999.56	42,617,999.56
利率敏感度缺口	44,116,905.71	-	-	655,174,633.98	699,291,539.69

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2015 年 6 月 30 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%

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,210,341,052.31	95.04	0.00	0.00
交易性金融资产-基金投资	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	0.00	0.00	0.00	0.00
其他	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	2,210,341,052.31	95.04	0.00	0.00

6.4.13.4.3.2 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6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	91,898,506.56	0.00
业绩比较基准下降5%	-91,898,506.56	0.00	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	2,210,341,052.31	89.89
	其中：股票	2,210,341,052.31	89.89
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	188,841,144.76	7.68
7	其他各项资产	59,827,928.21	2.43
8	合计	2,459,010,125.28	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,457,603,787.51	62.67
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	139,851,972.68	6.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	23,180,293.00	1.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	589,704,999.12	25.36
S	综合	-	-
	合计	2,210,341,052.31	95.04

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.3 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

7.3.1 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	300059	东方财富	3,452,355	217,809,076.95	9.37
2	600637	百视通	3,843,554	161,736,752.32	6.95
3	300104	乐视网	2,722,215	140,901,848.40	6.06
4	000503	海虹控股	2,104,469	103,118,981.00	4.43
5	300027	华谊兄弟	2,553,044	97,373,098.16	4.19
6	600804	鹏博士	3,258,732	97,305,737.52	4.18
7	000917	电广传媒	2,385,310	73,491,401.10	3.16
8	000839	中信国安	2,982,508	70,297,713.56	3.02
9	000793	华闻传媒	4,032,460	68,108,249.40	2.93
10	300017	网宿科技	1,434,237	66,577,281.54	2.86
11	600037	歌华有线	2,056,999	64,795,468.50	2.79
12	300058	蓝色光标	3,966,526	62,710,776.06	2.70
13	002400	省广股份	2,123,792	53,646,985.92	2.31
14	002439	启明星辰	1,457,900	50,005,970.00	2.15
15	300315	掌趣科技	3,607,725	48,884,673.75	2.10
16	601098	中南传媒	2,102,394	48,165,846.54	2.07
17	603000	人民网	808,996	42,172,961.48	1.81
18	300291	华录百纳	1,100,636	41,560,015.36	1.79
19	601929	吉视传媒	2,577,670	38,974,370.40	1.68
20	600373	中文传媒	1,621,521	38,851,643.16	1.67
21	601928	凤凰传媒	2,234,495	38,209,864.50	1.64
22	600633	浙报传媒	1,738,850	34,081,460.00	1.47
23	300251	光线传媒	1,288,035	32,072,071.50	1.38
24	300359	全通教育	251,762	31,538,225.74	1.36
25	300133	华策影视	1,146,376	30,952,152.00	1.33
26	300166	东方国信	825,965	29,668,662.80	1.28
27	300383	光环新网	368,662	26,945,505.58	1.16
28	300113	顺网科技	489,429	26,233,394.40	1.13
29	300226	上海钢联	321,327	26,027,487.00	1.12
30	600825	新华传媒	1,529,000	25,366,110.00	1.09
31	600757	长江传媒	1,780,702	24,751,757.80	1.06
32	002095	生意宝	369,977	23,637,830.53	1.02
33	000802	北京文化	796,300	23,180,293.00	1.00

34	300339	润和软件	416,750	20,041,507.50	0.86
35	002181	粤传媒	1,359,245	19,980,901.50	0.86
36	600831	广电网络	1,154,345	19,589,234.65	0.84
37	300295	三六五网	169,511	19,559,874.29	0.84
38	002315	焦点科技	172,929	16,601,184.00	0.71
39	600088	中视传媒	485,244	15,658,823.88	0.67
40	601801	皖新传媒	532,585	15,535,504.45	0.67
41	300392	腾信股份	115,900	15,500,466.00	0.67
42	300336	新文化	631,063	15,044,541.92	0.65
43	300052	中青宝	456,487	14,561,935.30	0.63
44	000156	华数传媒	377,770	13,516,610.60	0.58
45	600551	时代出版	592,293	12,858,681.03	0.55
46	002238	天威视讯	489,320	11,626,243.20	0.50
47	300364	中文在线	105,900	10,701,195.00	0.46
48	002071	长城影视	461,350	9,734,485.00	0.42
49	601999	出版传媒	645,151	9,174,047.22	0.39
50	300148	天舟文化	371,920	7,988,841.60	0.34
51	002712	思美传媒	48,220	3,513,309.20	0.15

7.3.2 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：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600637	东方明珠	376,421,621.28	53.83
2	300059	东方财富	319,228,009.72	45.65
3	300104	乐视网	230,425,234.84	32.95
4	600804	鹏博士	187,949,024.60	26.88
5	300027	华谊兄弟	178,956,926.78	25.59
6	000503	海虹控股	171,004,395.19	24.45
7	300058	蓝色光标	126,033,383.23	18.02
8	600037	歌华有线	103,260,414.26	14.77
9	002400	省广股份	101,473,213.62	14.51

10	300315	掌趣科技	101,186,228.46	14.47
11	601098	中南传媒	98,886,695.91	14.14
12	603000	人民网	97,344,266.02	13.92
13	000839	中信国安	96,845,326.63	13.85
14	300017	网宿科技	94,953,996.14	13.58
15	000793	华闻传媒	91,616,149.36	13.10
16	300251	光线传媒	88,874,622.72	12.71
17	000917	电广传媒	87,080,996.56	12.45
18	600633	浙报传媒	84,020,988.66	12.02
19	601929	吉视传媒	78,572,778.81	11.24
20	002439	启明星辰	72,353,728.10	10.35
21	601928	凤凰传媒	69,865,933.76	9.99
22	300226	上海钢联	64,049,016.78	9.16
23	600373	中文传媒	62,193,043.36	8.89
24	300291	华录百纳	61,544,566.24	8.80
25	300133	华策影视	58,240,463.93	8.33
26	000802	北京文化	56,551,001.28	8.09
27	300359	全通教育	53,031,258.07	7.58
28	002181	粤传媒	51,450,839.53	7.36
29	002095	生意宝	50,423,501.04	7.21
30	300166	东方国信	45,757,279.67	6.54
31	600757	长江传媒	45,319,958.33	6.48
32	600825	新华传媒	45,230,175.31	6.47
33	300295	三六五网	43,809,324.27	6.26
34	300392	腾信股份	35,987,295.14	5.15
35	600831	广电网络	34,251,698.56	4.90
36	000156	华数传媒	34,124,748.26	4.88
37	002315	焦点科技	31,525,946.74	4.51
38	300052	中青宝	31,129,004.52	4.45
39	300336	新文化	31,000,881.51	4.43
40	300383	光环新网	30,692,618.99	4.39
41	300364	中文在线	29,712,085.46	4.25
42	300113	顺网科技	27,849,547.59	3.98
43	601801	皖新传媒	27,527,796.99	3.94
44	600088	中视传媒	26,854,142.58	3.84
45	600551	时代出版	26,421,497.29	3.78

46	002071	长城影视	22,355,373.96	3.20
47	300339	润和软件	20,038,144.82	2.87
48	300245	天玑科技	19,125,468.70	2.73
49	601999	出版传媒	18,669,467.03	2.67
50	002238	天威视讯	17,060,676.47	2.44

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。

7.4.2 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	300059	东方财富	247,835,127.71	35.44
2	300104	乐视网	205,416,468.99	29.37
3	600637	东方明珠	198,936,648.36	28.45
4	300027	华谊兄弟	158,588,736.09	22.68
5	600804	鹏博士	155,057,724.00	22.17
6	000503	海虹控股	134,735,090.19	19.27
7	600037	歌华有线	88,429,470.36	12.65
8	300058	蓝色光标	87,786,274.91	12.55
9	300251	光线传媒	86,086,049.24	12.31
10	601098	中南传媒	81,586,676.36	11.67
11	000839	中信国安	81,112,789.72	11.60
12	603000	人民网	80,262,721.12	11.48
13	002400	省广股份	79,254,073.90	11.33
14	300017	网宿科技	76,099,779.14	10.88
15	600633	浙报传媒	69,610,499.12	9.95
16	601929	吉视传媒	66,667,689.61	9.53
17	000793	华闻传媒	65,423,049.38	9.36
18	000917	电广传媒	64,252,904.81	9.19
19	601928	凤凰传媒	61,380,500.85	8.78
20	300315	掌趣科技	50,370,792.92	7.20
21	600373	中文传媒	50,159,975.20	7.17
22	002439	启明星辰	48,699,918.49	6.96
23	300133	华策影视	47,297,984.66	6.76
24	002181	粤传媒	46,954,671.09	6.71
25	300226	上海钢联	46,323,112.43	6.62
26	300291	华录百纳	44,100,347.32	6.31
27	002095	生意宝	42,149,506.07	6.03

28	600825	新华传媒	39,721,221.47	5.68
29	600757	长江传媒	38,674,259.51	5.53
30	300166	东方国信	31,283,076.72	4.47
31	300295	三六五网	31,172,972.16	4.46
32	300359	全通教育	30,887,537.39	4.42
33	300245	天玑科技	30,886,442.93	4.42
34	600831	广电网络	28,698,418.19	4.10
35	002315	焦点科技	27,024,111.08	3.86
36	300336	新文化	26,599,312.06	3.80
37	300052	中青宝	25,604,932.27	3.66
38	600088	中视传媒	23,985,623.37	3.43
39	601801	皖新传媒	23,484,737.53	3.36
40	600551	时代出版	22,666,209.03	3.24
41	000802	北京文化	22,251,277.20	3.18
42	000156	华数传媒	20,841,219.05	2.98
43	300113	顺网科技	19,826,253.76	2.84
44	300383	光环新网	17,795,153.50	2.54
45	300339	润和软件	17,001,128.47	2.43
46	601999	出版传媒	15,950,915.66	2.28
47	000719	大地传媒	15,257,627.55	2.18

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。

7.4.3 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	3,981,176,748.28
卖出股票收入（成交）总额	3,037,809,553.13

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未发生股指期货投资。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券之一的鹏博士电信传媒集团股份有限公司（以下简称“鹏博士”）于 2014 年 10 月 24 日收到中国证券监督管理委员会四川监管局《关于对鹏博士电信传媒集团股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（行政监管措施决定书[2014]15 号）（以下简称“《监管警示函》”）。《监管警示函》指出鹏博士披露的 2011、2012、2013 年年度财务报告中现金流量表及补充资料的数据存在错误，要求鹏博士及时披露经审计的更正后的财务信息。根据鹏博士公告，鹏博士按照《企业会计准则》的规定，会同年审会计师，对公司 2011 年至 2013 年度财务报告进行了全面的梳理核查并进行差错更正，并按照证监会和上海证券交易所的相关规定，整理《关于公司

前期会计差错更正的议案》提交公司董事会进行审议并履行了信息披露义务。

对上述股票的投资决策程序的说明：本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数，控制跟踪误差，对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置，符合指数基金的管理规定，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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	1,276,881.52
2	应收证券清算款	51,322,613.48
3	应收股利	-
4	应收利息	48,195.72
5	应收申购款	7,180,237.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	59,827,928.21

7.12.4 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可转换债券。

7.12.5 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	000839	中信国安	70,297,713.56	3.02	重大事项停牌
2	000793	华闻传媒	68,108,249.40	2.93	重大事项停牌
3	000917	电广传媒	73,491,401.10	3.16	重大事项停牌

7.12.6 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.12.7 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
传媒分 级	47,394	21,506.59	334,490,458.45	32.82%	684,792,729.03	67.18%
传媒分 级 A	1,481	422,704.04	451,531,575.00	72.13%	174,493,101.00	27.87%
传媒分 级 B	18,558	33,733.41	139,755,346.00	22.32%	486,269,330.00	77.68%
合计	67,433	33,682.80	925,777,379.45	40.76%	1,345,555,160.03	59.24%

8.2 期末上市基金前十名持有人

传媒分级 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司 —分红-个人分红	42,433,819.00	6.78%
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司 —传统—普通保险产品	40,614,803.00	6.49%
3	全国社保基金二零六组合	32,576,594.00	5.20%
4	胡学红	32,147,006.00	5.14%
5	中国平安财产保险股份有限公司— 传统—普通保险产品	30,859,836.00	4.93%
6	中国太平洋财产保险—传统—普通 保险产品-013C-CT001 深	27,798,296.00	4.44%

7	方金水	26,410,719.00	4.22%
8	中国人寿再保险股份有限公司	24,562,241.00	3.92%
9	新华人寿保险股份有限公司	23,955,918.00	3.83%
10	海通资管—上海银行—海通赢家系列一月月赢集合资产管理计划	21,309,767.00	3.40%

传媒分级 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	60,666,179.00	9.69%
2	清华大学教育基金会	22,183,322.00	3.54%
3	宋伟铭	21,140,000.00	3.38%
4	中信证券股份有限公司	9,999,905.00	1.60%
5	爱建证券有限责任公司	7,659,106.00	1.22%
6	晏金蒲	6,072,200.00	0.97%
7	赵静明	5,000,000.00	0.80%
8	黄敏娟	4,296,102.00	0.69%
9	马明星	3,938,501.00	0.63%
10	陈伟坚	3,301,000.00	0.53%

注：持有人为场内持有人。

8.3 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	传媒分级	318,859.37	0.0313%
	传媒分级 A	-	-
	传媒分级 B	-	-
	合计	318,859.37	0.0140%

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。

8.4 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

项目	份额级别	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	传媒分级	10~50
	传媒分级 A	-
	传媒分级 B	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	传媒分级	-
	传媒分级 A	-
	传媒分级 B	-

	合计	-
--	----	---

注：（1）本公司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。

（2）本基金的基金经理本报告期末未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	传媒分级	传媒分级 A	传媒分级 B
基金合同生效日(2014 年 12 月 11 日)	299,557,665.74	29,090,398.00	29,090,398.00
基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	394,775,021.97	167,613,595.00	167,613,595.00
本报告期基金总申购份额	6,191,584,651.53	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	5,215,502,283.97	-	-
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-351,574,202.05	458,411,081.00	458,411,081.00
本报告期末基金份额总额	1,019,283,187.48	626,024,676.00	626,024,676.00

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及不定期折算变动的份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

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。

报告期内经公司股东会审议通过，公司聘任陈冰女士担任公司监事，并自陈冰女士担任公司监事之日起，李国阳先生不再担任公司监事。陈冰女士任职日期自 2015 年 6 月 2 日起。

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。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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。本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
国信证券	1	2,271,487,103.80	32.36%	2,010,040.96	32.19%	-
国泰君安	2	1,554,169,654.44	22.14%	1,380,913.13	22.12%	-
中航证券	2	1,544,832,543.61	22.01%	1,371,075.98	21.96%	本期新增
广发证券	1	348,161,883.67	4.96%	313,936.44	5.03%	本期新增
中金公司	1	300,903,511.98	4.29%	270,126.77	4.33%	本期新增
招商证券	1	243,327,266.96	3.47%	218,726.22	3.50%	本期新增
安信证券	2	214,767,970.71	3.06%	192,659.47	3.09%	本期新增
平安证券	1	209,155,382.87	2.98%	187,382.57	3.00%	-
华西证券	1	182,400,581.04	2.60%	164,102.76	2.63%	本期新增
方正证券	1	75,302,981.92	1.07%	67,989.40	1.09%	-
中信证券	1	74,477,420.41	1.06%	66,780.30	1.07%	-
中投证券	1	-	-	-	-	本期新增
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	本期新增
中信建投	1	-	-	-	-	本期新增
兴业证券	1	-	-	-	-	本期新增
华创证券	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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金本报告期内未通过券商交易单元进行权证交易、债券交易及债券回购交易。

10.8 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	鹏华中证传媒指数分级证券投资基金之鹏华传媒 A 份额 2015 年度约定年基准收益率的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 6 日
2	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 6 日
3	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 7 日
4	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 7 日
5	鹏华基金管理有限公司关于增加交通银行股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 1 月 12 日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股	《中国证券报》、《上海	2015 年 1 月 14

	票停牌后估值方法变更的提示性公告	证券报》、《证券时报》	日
7	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年1月21日
8	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年1月21日
9	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年1月21日
10	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年2月4日
11	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年2月7日
12	基金高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年2月9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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年2月12日
14	鹏华基金管理有限公司关于增加天风证券股份有限公司为我司旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年2月13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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年2月14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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年2月14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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年2月17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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年2月17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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年2月17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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年2月25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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年2月27日
22	鹏华基金管理有限公司关于新增中国邮政储蓄银行为旗下部分开放式基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月3日
23	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在邮储银行开通定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月3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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月3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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月3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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月3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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月5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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月6日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下指数分级基金开展网上直销与直销柜台转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月9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估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月11日
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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月14日
32	鹏华基金管理有限公司关于增加东莞农村商业银行股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月16日
33	鹏华基金管理有限公司关于增加中国工商银行为鹏华旗下部分开放式基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月18日
34	鹏华中证传媒指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月19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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月19日
36	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月21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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月21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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月21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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月24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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月24日
41	鹏华中证传媒指数分级证券投资基金不定期份额折算公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月24日
42	关于鹏华中证传媒指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间传媒 A 份额、传媒 B 份额停复牌公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月25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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月25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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月25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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月25日
46	鹏华中证传媒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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月26日
47	关于鹏华中证传媒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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月26日
48	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股	《中国证券报》、《上海	2015年3月27

	票停牌后估值方法变更的提示性公告	证券报》、《证券时报》	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月27日
50	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年3月31日
51	鹏华基金管理有限公司关于参与中国工商银行电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月1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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月1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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月2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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月2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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月3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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月3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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月4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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月4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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月7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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月7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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月9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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月13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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月13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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月14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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月15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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月16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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月18日
68	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分指数分级基金单笔申购、定期定额投资最低金额与持有最低份额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月20日
69	2015年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月21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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月23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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月23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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月23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估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月24日
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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月28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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年4月28日
76	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年5月7日
77	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年5月8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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年5月8日
79	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分分级指数基金申购费率的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年5月8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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年5月9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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年5月12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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年5月12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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年5月12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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年5月12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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年5月13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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年5月15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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年5月16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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年5月19日
89	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年5月19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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年5月21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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年5月22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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年5月29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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月2日
116	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月2日
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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月3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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月3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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月3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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月3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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月3日
122	鹏华中证传媒指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月3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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月6日
124	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月9日
125	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月9日
126	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月11日
127	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月11日
128	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月12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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月12日
130	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月13日
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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月13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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月16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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月17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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月17日

178	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年6月30日
-----	--	------------------------	------------

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证传媒指数分级证券投资基金基金合同》;
- (二)《鹏华中证传媒指数分级证券投资基金托管协议》;
- (三)《鹏华中证传媒指数分级证券投资基金 2015 年半年度报告》(原文)。

11.2 存放地点

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

北京市西城区金融大街 25 号中国建设银行股份有限公司

11.3 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
2015年8月25日