

# 鹏华环保产业股票型证券投资基金 2015 年年度报告摘要

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 30 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华环保产业股票
场内简称	-
基金主代码	000409
交易代码	000409
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月7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	357,520,521.01份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险前提下，精选优质的环保产业上市公司，力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场走势及证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，运用定量及定性相结合的手段，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过定性与定量相结合的积极投资策略，自下而上地精选价值被低估并且具有良好基本面的环保产业股票构建投资组合。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金通过久期配置、类属配置、期限结构配置等，采取积极主动的投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现债券组合增值。</p> <p>4、权证投资策略</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及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p>
业绩比较基准	中证环保产业指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于证券投资

基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。
----------------------

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鹏华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈
	联系电话	0755-82825720
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn
客户服务电话	4006788999	010-67595096
传真	0755-82021126	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com">http://www.phfund.com</a>
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 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行股份有限公司

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年 3 月 7 日(基金合同生效日)- 2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	90,065,259.66	36,932,610.39
本期利润	91,114,798.49	51,106,909.85
加权平均基金份额本期利润	0.2551	0.0931
本期基金份额净值增长率	47.07%	9.40%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3785	0.0939
期末基金资产净值	575,370,184.21	154,471,090.72
期末基金份额净值	1.609	1.094

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

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

(3) 表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

(4) 本基金基金合同于 2014 年 3 月 7 日生效，至 2014 年 12 月 31 日未满一年，故 2014 年的数据和指标为非完整会计年度数据。

## 3.2 基金净值表现

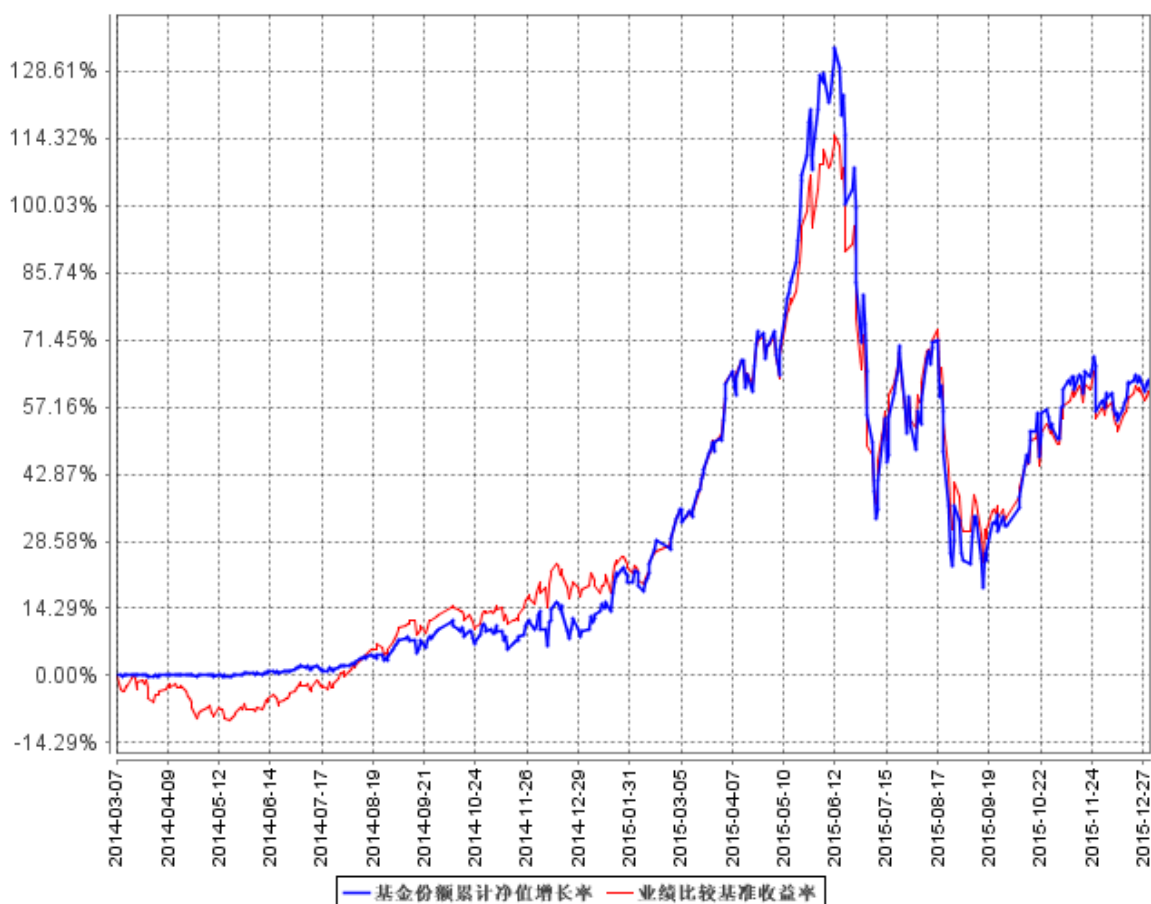
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	22.17%	1.91%	18.85%	1.60%	3.32%	0.31%
过去六个月	-11.10%	3.13%	-7.83%	2.57%	-3.27%	0.56%
过去一年	47.07%	2.76%	34.67%	2.28%	12.40%	0.48%
自基金合同生效起至今	60.90%	2.12%	59.09%	1.82%	1.81%	0.30%

注：业绩比较基准=中证环保产业指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

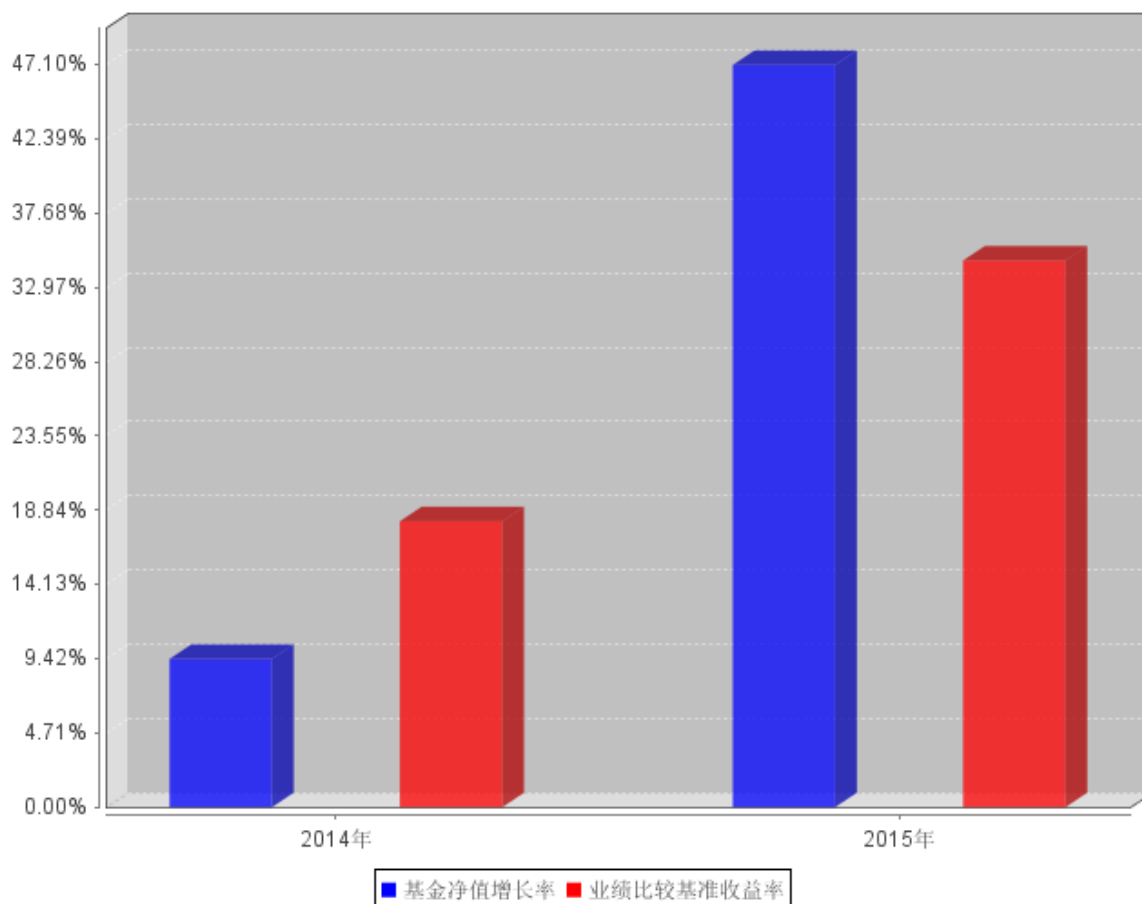


注：1、本基金基金合同于 2014 年 3 月 7 日生效。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同于 2014 年 3 月 7 日生效。截止本报告期末，本基金未进行利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业。公司原注册资本 8,000 万元人民币，后于 2001 年 9 月完成增资扩股，增至 15,000 万元人民币。截止本报告期末，公司管理 88 只开放式基金和 10 只社保组合，经过 17 年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁浩	本基金基金经理	2014年3月7日	2015年12月29日	7	梁浩先生，国籍中国，经济学博士，7年证券从业经验。曾任职于信息产业部电信研究院，从事产业政策研究工作；2008年5月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，担任研究部高级研究员、基金经理助理，2014年3月至2015年12月兼任鹏华环保产业股票基金基金经理，2014年11月至2015年12月兼任鹏华先进制造股票基金基金经理，2011年



					<p>7月起担任鹏华新兴产业混合基金基金经理，2015年7月起兼任鹏华动力增长混合（LOF）基金基金经理，现同时担任研究部总经理、投资决策委员会成员。梁浩先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，梁浩不再担任本基金基金经理，仅由郑川江担任本基金基金经理。</p>
郑川江	本基金基金经理	2015年6月5日	-	6	<p>郑川江先生，国籍中国，经济学硕士，6年金融证券从业经验。历任鹏华基金管理有限公司研究员，长城证券研</p>

					<p>究所研究员、所长助理； 2015 年 2 月加盟鹏华基金管理有限公司，任职于研究部，从事行业研究工作， 2015 年 6 月起担任鹏华环保产业股票基金基金经理。 郑川江先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，梁浩不再担任本基金基金经理，仅由郑川江担任本基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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对基金财产造成损失的异常交易行为。

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 1 次，主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内, 宏观经济增速持续回落, 投资、消费持续回落, 政府基于稳增长考虑, 持续推出各类财政和产业刺激政策, 货币政策进一步宽松, 改革措施也进一步出台。

2015 年作为新环保法实施元年, 政府铁腕治理环境的行动已经展开, 环保政策执行力度不断加强, 限制或者减少各类污染源的举措将越来越多出现, 传统行业向大环保领域的布局现象也将增加, 行业景气度持续提升, 利好事件持续涌现, 上市公司订单与资本运作动作活跃, 经过三季度市场系统性调整, 大部分个股都出现了较大的投资机会。我们坚持选择市场空间大, 景气持续时间长的行业进行重点配置, 本季度本基金坚持大环保的投资思路, 污染治理, 污染源控制、新能源、新能源汽车等子行业加大了配置, 同时增加了部分预期不高但有积极改善的公司。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 47.07%，同期上证综指上涨 9.41%，深证成指上涨 14.98%，沪深 300 指数上涨 5.58%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一季度，传统高耗能高污染行业节能和清洁化改造仍将维持高景气，传统过剩产业将进一步感受到来自环保部门的压力，政府对于僵尸行业去产能的决心较大，而这些行业本身也因为效益不佳新增产能少。在宏观经济持续走弱的环境下，汇率、利率、债券以及楼市等目标之间冲突加大，四季度成长股大幅度反弹造成企业实际成长进度与市场预期的不匹配，二级市场不具备系统性投资机会，但在整个社会转型升级过程中，部分行业和公司确实迎来了非常好的发展机遇，从中长期角度来看仍然要积极关注其投资价值。十三五规划的关注以及稳增长需求下的产业扶持政策等将给市场持续制造热点。能源互联网、清洁煤、新能源汽车产业链中充电桩、储能等子版块以及国企改革主题值得重点关注。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

###### (1) 日常估值流程

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

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

###### (2) 特殊业务估值流程

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

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

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

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、本公司现没有进行任何定价服务的签约。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 135,328,516.14 元，期末基金份额净值 1.609 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：鹏华环保产业股票型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		109,183,280.80	21,100,069.43
结算备付金		1,776,848.69	35,301.13
存出保证金		549,220.55	149,647.65
交易性金融资产		481,597,523.62	132,868,756.71
其中：股票投资		481,597,523.62	132,868,756.71
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		11,798,279.64	2,885,608.17
应收利息		21,840.55	3,381.21
应收股利		-	-
应收申购款		1,574,408.86	337,258.14
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		606,501,402.71	157,380,022.44
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		26,535,365.97	1,006,639.30

应付赎回款		1,553,433.78	1,201,051.00
应付管理人报酬		730,916.33	210,477.19
应付托管费		121,819.36	35,079.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,830,416.67	155,388.56
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		359,266.39	300,296.11
负债合计		31,131,218.50	2,908,931.72
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		357,520,521.01	141,211,519.33
未分配利润		217,849,663.20	13,259,571.39
所有者权益合计		575,370,184.21	154,471,090.72
负债和所有者权益总计		606,501,402.71	157,380,022.44

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.609 元，基金份额总额 357,520,521.01 份。

## 7.2 利润表

会计主体：鹏华环保产业股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 3 月 7 日(基 金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		111,704,278.18	60,697,776.60
1. 利息收入		658,688.83	4,973,309.71
其中：存款利息收入		658,688.83	1,615,001.21
债券利息收入		-	17,153.88
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	3,341,154.62
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		100,268,393.53	39,995,245.30
其中：股票投资收益		96,752,056.88	35,040,019.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	3,560,314.77
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		3,516,336.65	1,394,910.88
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		1,049,538.83	14,174,299.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		9,727,656.99	1,554,922.13
<b>减：二、费用</b>		20,589,479.69	9,590,866.75
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	8,497,558.50	6,857,556.30
2. 托管费	7.4.8.2.2	1,416,259.69	1,142,926.17
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		10,300,674.45	1,275,803.49
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		374,987.05	314,580.79
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		91,114,798.49	51,106,909.85
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		91,114,798.49	51,106,909.85

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华环保产业股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	141,211,519.33	13,259,571.39	154,471,090.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	91,114,798.49	91,114,798.49
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）	216,309,001.68	113,475,293.32	329,784,295.00
其中：1. 基金申购款	1,289,977,999.20	856,267,331.95	2,146,245,331.15
2. 基金赎回款	-1,073,668,997.52	-742,792,038.63	-1,816,461,036.15

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）	357,520,521.01	217,849,663.20	575,370,184.21
项目	上年度可比期间 2014年3月7日(基金合同生效日)至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	841,094,897.79	-	841,094,897.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	51,106,909.85	51,106,909.85
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）	-699,883,378.46	-37,847,338.46	-737,730,716.92
其中：1. 基金申购款	57,131,607.50	4,867,662.47	61,999,269.97
2. 基金赎回款	-757,014,985.96	-42,715,000.93	-799,729,986.89
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）	141,211,519.33	13,259,571.39	154,471,090.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
邓召明

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
高鹏

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
郝文高

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

鹏华环保产业股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]第1345号《关于核准鹏华环保产业股票型证券投资基金募集的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华环保产业股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。

本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 840,606,007.08 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 106 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华环保产业股票型证券投资基金基金合同》于 2014 年 3 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 841,094,897.79 份基金份额，其中认购资金利息折合 488,890.71 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华环保产业股票型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：股票资产占基金资产的 80%-95%，投资于环保产业的上市公司发行的股票占非现金资产的比例不低于 80%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；投资于现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为：中证环保产业指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

##### 7.4.4.1 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），对于交易

所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 7.4.4.2 本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

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

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

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

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

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

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司(“鹏华基金公司”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

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

注：1、本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2014年3月7日(基金合同生效日)至2014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	1,606,379,966.04	23.11%	146,589,015.48	16.72%

###### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年3月7日(基金合同生效日)至2014年 12月31日	
	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 成交总额的比 例
国信证券	-	-	1,434,421.65	4.75%

###### 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 2015年1月1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	1,440,354.73	23.09%	599,886.49	32.77%
关联方名称	上年度可比期间 2014年3月7日(基金合同生效日)至2014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	129,716.90	16.72%	44,941.46	28.92%

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。

### 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 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年3月7日(基金合同生效日) 至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,497,558.50	6,857,556.30
其中：支付销售机构的客户维护费	3,490,064.37	4,833,958.38

注：（1）支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为 1.50%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

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

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,416,259.69	1,142,926.17

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费年费率为 0.25%，逐日计提，按月支付。  
日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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没有投资及持有本基金份额。

### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		2014 年 3 月 7 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	109,183,280.80	596,315.08	21,100,069.43	1,576,279.57

### 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：本基金本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销的证券。

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

### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票	股票	停牌日期	停牌原	期末	复牌日期	复牌	数量（股）	期末	期末估值总	备注
----	----	------	-----	----	------	----	-------	----	-------	----

代码	名称		因	估值单价		开盘单价		成本总额	额	
300326	凯利泰	2015年9月24日	重大事项	27.92	2016年1月22日	23.98	510,000	13,148,208.34	14,239,200.00	-
000925	众合科技	2015年11月3日	重大事项	20.26	-	-	400,000	8,448,146.03	8,104,000.00	-
002340	格林美	2015年12月29日	重大事项	15.20	2016年1月6日	14.35	312,934	3,472,404.05	4,756,596.80	-
600584	长电科技	2015年11月30日	重大事项	22.02	-	-	203,900	3,123,498.84	4,489,878.00	-
002011	盾安环境	2015年12月28日	重大事项	16.72	2016年2月22日	15.05	220,100	2,900,194.45	3,680,072.00	-
000035	中国天楹	2015年12月14日	重大事项	15.35	2016年2月18日	13.82	239,400	3,773,688.32	3,674,790.00	-
000712	锦龙股份	2015年12月25日	重大事项	29.12	2016年1月4日	28.00	91,218	2,485,192.24	2,656,268.16	-
300036	超图软件	2015年10月30日	重大事项	43.18	2016年1月15日	35.11	33,300	1,170,682.00	1,437,894.00	-

### 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

注：无。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：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	481,597,523.62	79.41
	其中：股票	481,597,523.62	79.41
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	110,960,129.49	18.30
7	其他各项资产	13,943,749.60	2.30
8	合计	606,501,402.71	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	17,044,790.00	2.96
B	采矿业	-	-
C	制造业	272,518,907.12	47.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	69,929,995.82	12.15
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,651,560.15	1.68
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	30,906,474.93	5.37
J	金融业	2,656,268.16	0.46
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	14,258,609.86	2.48
N	水利、环境和公共设施管理业	25,208,417.96	4.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	21,498,499.62	3.74
R	文化、体育和娱乐业	10,164,000.00	1.77
S	综合	7,760,000.00	1.35
	合计	481,597,523.62	83.70

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	1,850,847	25,097,485.32	4.36
2	300335	迪森股份	1,193,325	22,124,245.50	3.85
3	000709	河北钢铁	6,499,927	21,644,756.91	3.76
4	300070	碧水源	415,948	21,533,627.96	3.74
5	300244	迪安诊断	309,153	21,498,499.62	3.74
6	300145	南方泵业	370,600	17,647,972.00	3.07
7	002200	云投生态	658,100	17,044,790.00	2.96
8	600886	国投电力	2,000,000	16,700,000.00	2.90
9	002126	银轮股份	900,000	16,605,000.00	2.89
10	300362	天保重装	250,000	15,180,000.00	2.64

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	601398	工商银行	110,599,879.97	71.60
2	000925	众合科技	93,710,922.83	60.67
3	300070	碧水源	81,699,981.31	52.89
4	300244	迪安诊断	74,420,331.94	48.18
5	000802	北京文化	66,520,310.61	43.06
6	300335	迪森股份	59,122,755.35	38.27
7	300156	神雾环保	58,531,106.51	37.89
8	300187	永清环保	55,940,827.08	36.21
9	000601	韶能股份	55,410,903.82	35.87
10	002340	格林美	53,274,804.46	34.49
11	600900	长江电力	47,960,828.04	31.05
12	000544	中原环保	46,674,659.33	30.22
13	002616	长青集团	45,194,364.16	29.26
14	000690	宝新能源	43,051,463.76	27.87
15	300362	天保重装	42,387,654.52	27.44
16	600703	三安光电	41,359,140.53	26.77

17	601288	农业银行	38,753,953.71	25.09
18	300145	南方泵业	36,837,042.65	23.85
19	600292	中电远达	32,640,349.00	21.13
20	002658	雪迪龙	32,616,856.70	21.12
21	002241	歌尔声学	32,154,606.97	20.82
22	600856	中天能源	31,212,478.05	20.21
23	600028	中国石化	30,841,143.00	19.97
24	002672	东江环保	29,908,353.48	19.36
25	300068	南都电源	29,346,144.97	19.00
26	002200	云投生态	29,193,377.74	18.90
27	000001	平安银行	28,447,701.20	18.42
28	002126	银轮股份	26,920,616.20	17.43
29	600406	国电南瑞	26,886,509.46	17.41
30	002202	金风科技	26,685,022.42	17.28
31	000333	美的集团	26,032,466.70	16.85
32	300203	聚光科技	25,984,736.61	16.82
33	300165	天瑞仪器	25,970,960.51	16.81
34	600674	川投能源	25,796,935.74	16.70
35	600517	置信电气	24,857,082.13	16.09
36	600886	国投电力	24,377,422.82	15.78
37	600651	飞乐音响	24,317,290.34	15.74
38	601166	兴业银行	24,141,143.98	15.63
39	601988	中国银行	23,400,000.00	15.15
40	002310	东方园林	22,736,070.65	14.72
41	002594	比亚迪	21,858,974.95	14.15
42	000957	中通客车	21,631,685.63	14.00
43	000709	河北钢铁	21,571,903.64	13.97
44	601012	隆基股份	21,174,924.57	13.71
45	002421	达实智能	21,088,109.84	13.65
46	600527	江南高纤	20,614,279.62	13.35
47	600416	湘电股份	20,244,626.74	13.11
48	600268	国电南自	20,213,052.00	13.09
49	002348	高乐股份	19,952,762.56	12.92
50	300274	阳光电源	19,918,114.68	12.89
51	000685	中山公用	19,898,589.20	12.88
52	600151	航天机电	19,848,832.28	12.85

53	300326	凯利泰	19,711,706.72	12.76
54	002400	省广股份	19,597,938.27	12.69
55	600563	法拉电子	19,317,251.77	12.51
56	002250	联化科技	18,806,977.88	12.18
57	300055	万邦达	18,778,628.40	12.16
58	601179	中国西电	18,637,351.00	12.07
59	600681	万鸿集团	18,065,617.20	11.70
60	002249	大洋电机	17,625,002.70	11.41
61	600519	贵州茅台	17,512,407.06	11.34
62	300228	富瑞特装	17,492,908.52	11.32
63	300205	天喻信息	16,970,524.40	10.99
64	000541	佛山照明	16,899,028.97	10.94
65	002131	利欧股份	16,898,569.90	10.94
66	600323	瀚蓝环境	16,696,364.64	10.81
67	600388	龙净环保	16,607,657.00	10.75
68	000652	泰达股份	16,420,639.65	10.63
69	600008	首创股份	15,791,512.09	10.22
70	300069	金利华电	15,643,598.02	10.13
71	600261	阳光照明	15,580,416.10	10.09
72	000820	金城股份	15,552,167.48	10.07
73	002129	中环股份	15,462,272.09	10.01
74	000712	锦龙股份	15,444,723.10	10.00
75	300263	隆华节能	15,123,879.30	9.79
76	300197	铁汉生态	15,031,952.74	9.73
77	601388	怡球资源	15,025,948.16	9.73
78	300376	易事特	15,023,320.64	9.73
79	300332	天壕环境	15,006,589.00	9.71
80	000669	金鸿能源	14,784,569.35	9.57
81	600184	光电股份	14,746,813.80	9.55
82	300012	华测检测	14,595,407.19	9.45
83	000952	广济药业	14,585,374.88	9.44
84	002431	棕榈园林	14,115,192.94	9.14
85	000513	丽珠集团	14,105,631.36	9.13
86	002518	科士达	14,056,784.09	9.10
87	300422	博世科	14,014,624.00	9.07
88	600958	东方证券	13,899,089.00	9.00

89	000826	启迪桑德	13,828,728.70	8.95
90	300347	泰格医药	13,795,730.84	8.93
91	600499	科达洁能	13,574,622.42	8.79
92	600970	中材国际	13,312,664.28	8.62
93	002637	赞宇科技	13,177,165.00	8.53
94	002152	广电运通	13,100,000.00	8.48
95	300435	中泰股份	12,865,124.00	8.33
96	002479	富春环保	12,787,443.58	8.28
97	600481	双良节能	12,761,143.53	8.26
98	300058	蓝色光标	12,647,130.10	8.19
99	300090	盛运环保	12,575,711.15	8.14
100	300355	蒙草抗旱	12,465,633.96	8.07
101	601058	赛轮金宇	12,391,216.51	8.02
102	300105	龙源技术	11,970,829.76	7.75
103	300379	东方通	11,933,966.09	7.73
104	603108	润达医疗	11,872,618.00	7.69
105	000400	许继电气	11,541,032.00	7.47
106	300056	三维丝	11,344,657.35	7.34
107	300072	三聚环保	11,327,496.63	7.33
108	603366	日出东方	11,216,197.13	7.26
109	601991	大唐发电	11,088,000.00	7.18
110	000937	冀中能源	11,064,005.12	7.16
111	000012	南玻A	11,010,458.02	7.13
112	000810	创维数字	10,991,188.00	7.12
113	002011	盾安环境	10,964,303.54	7.10
114	600187	国中水务	10,846,411.89	7.02
115	002573	清新环境	10,799,586.00	6.99
116	000939	凯迪生态	10,407,376.68	6.74
117	603111	康尼机电	10,174,481.50	6.59
118	300429	强力新材	10,148,208.06	6.57
119	600459	贵研铂业	10,116,978.85	6.55
120	600875	东方电气	10,017,499.46	6.49
121	002663	普邦园林	9,985,447.25	6.46
122	000932	华菱钢铁	9,953,176.75	6.44
123	600168	武汉控股	9,874,135.05	6.39
124	600478	科力远	9,824,718.00	6.36

125	002266	浙富控股	9,796,190.00	6.34
126	600874	创业环保	9,741,245.96	6.31
127	600089	特变电工	9,595,212.00	6.21
128	600884	杉杉股份	9,408,461.18	6.09
129	600460	士兰微	9,302,102.80	6.02
130	300146	汤臣倍健	9,239,248.46	5.98
131	300437	清水源	9,194,000.00	5.95
132	601866	中海集运	9,179,396.00	5.94
133	002665	首航节能	9,175,297.08	5.94
134	000881	大连国际	9,174,807.99	5.94
135	000967	上风高科	8,952,580.58	5.80
136	600585	海螺水泥	8,909,363.37	5.77
137	603601	再升科技	8,748,258.60	5.66
138	600584	长电科技	8,606,120.70	5.57
139	600485	信威集团	8,589,224.19	5.56
140	300360	炬华科技	8,420,931.06	5.45
141	300111	向日葵	8,362,958.00	5.41
142	600037	歌华有线	8,307,965.00	5.38
143	300310	宜通世纪	8,061,592.28	5.22
144	600770	综艺股份	7,822,676.96	5.06
145	601199	江南水务	7,815,997.88	5.06
146	300004	南风股份	7,786,732.09	5.04
147	300110	华仁药业	7,711,616.69	4.99
148	002659	中泰桥梁	7,636,263.00	4.94
149	002005	德豪润达	7,620,178.00	4.93
150	300457	赢合科技	7,600,000.00	4.92
151	603686	龙马环卫	7,526,916.45	4.87
152	002218	拓日新能	7,501,508.22	4.86
153	600537	亿晶光电	7,498,801.54	4.85
154	300172	中电环保	7,497,467.00	4.85
155	603699	纽威股份	7,411,993.64	4.80
156	300323	华灿光电	7,398,117.34	4.79
157	002056	横店东磁	7,367,093.36	4.77
158	300296	利亚德	7,344,360.90	4.75
159	300083	劲胜精密	7,213,175.00	4.67
160	002630	华西能源	7,132,570.10	4.62

161	000598	兴蓉环境	7,129,468.96	4.62
162	002450	康得新	7,051,114.00	4.56
163	300028	金亚科技	6,999,811.00	4.53
164	002384	东山精密	6,940,260.04	4.49
165	601877	正泰电器	6,671,599.80	4.32
166	300207	欣旺达	6,664,877.00	4.31
167	000852	石化机械	6,646,637.98	4.30
168	002368	太极股份	6,641,398.00	4.30
169	002130	沃尔核材	6,462,299.00	4.18
170	601727	上海电气	6,346,094.00	4.11
171	603118	共进股份	6,309,000.00	4.08
172	300080	易成新能	6,271,466.48	4.06
173	300118	东方日升	6,216,778.18	4.02
174	300303	聚飞光电	6,036,926.89	3.91
175	002638	勤上光电	5,992,270.79	3.88
176	002334	英威腾	5,962,760.36	3.86
177	000786	北新建材	5,891,985.43	3.81
178	002466	天齐锂业	5,874,759.55	3.80
179	601158	重庆水务	5,786,208.00	3.75
180	300037	新宙邦	5,726,365.84	3.71
181	000695	滨海能源	5,662,896.00	3.67
182	000605	渤海股份	5,632,000.00	3.65
183	002341	新纶科技	5,614,487.24	3.63
184	002683	宏大爆破	5,590,968.10	3.62
185	000555	神州信息	5,491,151.12	3.55
186	000777	中核科技	5,444,185.16	3.52
187	600260	凯乐科技	5,443,357.61	3.52
188	002364	中恒电气	5,294,016.17	3.43
189	000002	万科A	5,244,544.00	3.40
190	000920	南方汇通	5,164,655.60	3.34
191	002531	天顺风能	5,133,412.05	3.32
192	600236	桂冠电力	5,088,438.77	3.29
193	002758	华通医药	4,906,002.00	3.18
194	601808	中海油服	4,873,430.36	3.15
195	000651	格力电器	4,844,515.00	3.14
196	000538	云南白药	4,619,927.00	2.99

197	601908	京运通	4,494,802.00	2.91
198	002080	中材科技	4,446,047.80	2.88
199	300334	津膜科技	4,421,275.78	2.86
200	601368	绿城水务	4,370,860.54	2.83
201	601599	鹿港科技	4,370,484.00	2.83
202	002183	怡亚通	4,270,401.00	2.76
203	603568	伟明环保	4,248,218.00	2.75
204	300262	巴安水务	4,210,285.00	2.73
205	002117	东港股份	4,197,727.00	2.72
206	600617	国新能源	4,182,299.00	2.71
207	002123	荣信股份	4,090,280.10	2.65
208	002013	中航机电	4,084,158.76	2.64
209	601688	华泰证券	4,069,735.00	2.63
210	600579	天华院	4,039,688.56	2.62
211	000035	中国天楹	4,030,627.00	2.61
212	002351	漫步者	3,959,485.00	2.56
213	002572	索菲亚	3,952,599.68	2.56
214	600522	中天科技	3,769,833.00	2.44
215	300137	先河环保	3,756,810.00	2.43
216	601699	潞安环能	3,746,725.60	2.43
217	601139	深圳燃气	3,691,957.09	2.39
218	601106	中国一重	3,605,490.00	2.33
219	601016	节能风电	3,597,050.08	2.33
220	000567	海德股份	3,596,935.00	2.33
221	002318	久立特材	3,588,616.76	2.32
222	000970	中科三环	3,489,048.00	2.26
223	002470	金正大	3,462,000.00	2.24
224	600571	信雅达	3,434,942.00	2.22
225	300152	科融环境	3,386,507.24	2.19
226	600526	菲达环保	3,373,440.92	2.18
227	000581	威孚高科	3,363,945.78	2.18
228	600021	上海电力	3,327,712.00	2.15
229	000797	中国武夷	3,239,929.88	2.10
230	000922	佳电股份	3,218,436.00	2.08
231	600271	航天信息	3,216,108.00	2.08
232	300425	环能科技	3,181,738.00	2.06



233	002309	中利科技	3,168,736.00	2.05
234	600098	广州发展	3,097,057.73	2.00

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	109,790,331.99	71.08
2	300244	迪安诊断	101,819,940.35	65.92
3	000925	众合科技	85,160,761.22	55.13
4	300070	碧水源	72,436,967.45	46.89
5	002616	长青集团	63,562,280.39	41.15
6	000802	北京文化	58,012,542.84	37.56
7	300156	神雾环保	56,706,732.97	36.71
8	300187	永清环保	55,891,001.54	36.18
9	002340	格林美	54,867,694.30	35.52
10	000601	韶能股份	54,053,507.16	34.99
11	002202	金风科技	40,001,904.00	25.90
12	002672	东江环保	39,560,126.44	25.61
13	600703	三安光电	38,863,061.34	25.16
14	300362	天保重装	38,789,956.13	25.11
15	601288	农业银行	36,528,007.82	23.65
16	000690	宝新能源	36,319,776.50	23.51
17	002658	雪迪龙	35,246,321.13	22.82
18	002152	广电运通	32,951,728.80	21.33
19	600651	飞乐音响	32,402,688.88	20.98
20	300335	迪森股份	32,113,036.86	20.79
21	300203	聚光科技	31,985,354.25	20.71
22	002250	联化科技	31,792,312.74	20.58
23	000544	中原环保	30,514,815.04	19.75
24	300165	天瑞仪器	30,507,605.81	19.75
25	000001	平安银行	29,834,902.35	19.31
26	600527	江南高纤	29,687,130.75	19.22
27	600856	中天能源	29,413,418.28	19.04
28	600292	中电远达	25,962,898.98	16.81
29	600028	中国石化	25,664,917.71	16.61
30	601166	兴业银行	25,590,884.56	16.57

31	600900	长江电力	25,057,468.26	16.22
32	601988	中国银行	23,555,735.40	15.25
33	002241	歌尔声学	23,081,871.08	14.94
34	600674	川投能源	22,125,542.42	14.32
35	000685	中山公用	21,595,027.46	13.98
36	000333	美的集团	21,567,000.00	13.96
37	300205	天喻信息	21,283,723.07	13.78
38	002348	高乐股份	21,199,076.54	13.72
39	002310	东方园林	21,113,012.41	13.67
40	300145	南方泵业	20,729,427.02	13.42
41	000820	金城股份	20,344,035.10	13.17
42	600416	湘电股份	20,131,499.76	13.03
43	300228	富瑞特装	20,066,317.81	12.99
44	601388	怡球资源	19,612,177.00	12.70
45	600151	航天机电	19,530,086.02	12.64
46	600517	置信电气	19,432,791.61	12.58
47	300422	博世科	19,213,653.00	12.44
48	002249	大洋电机	19,166,902.55	12.41
49	600406	国电南瑞	18,726,203.64	12.12
50	300068	南都电源	18,529,912.42	12.00
51	002129	中环股份	18,514,353.15	11.99
52	600681	万鸿集团	18,384,009.04	11.90
53	600519	贵州茅台	17,926,568.47	11.61
54	300274	阳光电源	17,762,858.59	11.50
55	002400	省广股份	17,275,519.48	11.18
56	000669	金鸿能源	17,235,184.00	11.16
57	000513	丽珠集团	17,179,853.35	11.12
58	600481	双良节能	16,601,704.19	10.75
59	002131	利欧股份	16,430,409.73	10.64
60	603108	润达医疗	16,148,406.20	10.45
61	000810	创维数字	16,077,243.00	10.41
62	600261	阳光照明	15,948,031.06	10.32
63	300197	铁汉生态	15,628,704.95	10.12
64	000400	许继电气	15,597,474.59	10.10
65	600008	首创股份	15,524,170.44	10.05
66	300435	中泰股份	15,473,892.56	10.02
67	600323	瀚蓝环境	15,196,512.78	9.84
68	300055	万邦达	15,168,185.51	9.82

69	000826	启迪桑德	14,965,299.72	9.69
70	300332	天壕环境	14,856,185.56	9.62
71	600970	中材国际	14,750,874.99	9.55
72	600388	龙净环保	14,691,088.26	9.51
73	600563	法拉电子	14,662,716.84	9.49
74	601179	中国西电	14,565,005.17	9.43
75	002200	云投生态	14,511,505.00	9.39
76	300090	盛运环保	14,139,295.30	9.15
77	600184	光电股份	14,037,094.55	9.09
78	300347	泰格医药	13,712,593.26	8.88
79	601058	赛轮金宇	13,618,298.20	8.82
80	000712	锦龙股份	13,530,753.86	8.76
81	300355	蒙草抗旱	12,816,836.50	8.30
82	600958	东方证券	12,687,396.00	8.21
83	002431	棕榈园林	12,626,296.19	8.17
84	002479	富春环保	12,554,784.20	8.13
85	002594	比亚迪	12,552,225.94	8.13
86	002126	银轮股份	12,534,096.47	8.11
87	300058	蓝色光标	12,442,608.63	8.05
88	300172	中电环保	12,257,832.03	7.94
89	601012	隆基股份	11,983,239.70	7.76
90	300429	强力新材	11,880,865.26	7.69
91	600478	科力远	11,846,403.43	7.67
92	000012	南玻A	11,772,507.17	7.62
93	600460	士兰微	11,444,979.22	7.41
94	000555	神州信息	11,415,929.03	7.39
95	300072	三聚环保	11,367,995.40	7.36
96	002573	清新环境	11,329,187.61	7.33
97	600499	科达洁能	11,197,699.89	7.25
98	603366	日出东方	11,126,543.58	7.20
99	603111	康尼机电	10,966,107.43	7.10
100	002266	浙富控股	10,930,950.89	7.08
101	002665	首航节能	10,902,923.10	7.06
102	000937	冀中能源	10,845,380.57	7.02
103	300146	汤臣倍健	10,841,820.60	7.02
104	600268	国电南自	10,820,838.00	7.01
105	000957	中通客车	10,792,000.00	6.99
106	300105	龙源技术	10,760,583.83	6.97

107	300056	三维丝	10,498,522.00	6.80
108	000939	凯迪生态	10,344,030.23	6.70
109	600459	贵研铂业	10,339,207.90	6.69
110	600187	国中水务	10,309,346.00	6.67
111	002659	中泰桥梁	10,079,620.90	6.53
112	000581	威孚高科	9,951,621.86	6.44
113	002663	普邦园林	9,948,892.13	6.44
114	600874	创业环保	9,858,960.51	6.38
115	300111	向日葵	9,671,493.52	6.26
116	300069	金利华电	9,659,061.00	6.25
117	600770	综艺股份	9,608,752.28	6.22
118	002664	信质电机	9,600,985.00	6.22
119	600585	海螺水泥	9,463,280.00	6.13
120	601991	大唐发电	9,404,081.00	6.09
121	000541	佛山照明	9,395,230.11	6.08
122	002421	达实智能	9,357,869.44	6.06
123	600485	信威集团	9,278,036.14	6.01
124	600089	特变电工	9,239,442.78	5.98
125	600875	东方电气	9,059,943.23	5.87
126	600168	武汉控股	8,676,726.21	5.62
127	600537	亿晶光电	8,638,593.69	5.59
128	601727	上海电气	8,524,175.34	5.52
129	600037	歌华有线	8,476,930.49	5.49
130	002056	横店东磁	8,431,061.00	5.46
131	601866	中海集运	8,348,141.42	5.40
132	002005	德豪润达	8,274,060.22	5.36
133	002470	金正大	8,225,965.77	5.33
134	300360	炬华科技	8,092,651.53	5.24
135	600884	杉杉股份	8,040,411.06	5.21
136	300110	华仁药业	8,038,684.00	5.20
137	300004	南风股份	8,022,758.14	5.19
138	002630	华西能源	8,000,129.03	5.18
139	002518	科士达	7,928,348.82	5.13
140	002384	东山精密	7,839,655.00	5.08
141	002218	拓日新能	7,776,048.32	5.03
142	002011	盾安环境	7,733,949.48	5.01
143	002683	宏大爆破	7,705,955.00	4.99
144	300457	赢合科技	7,670,227.00	4.97

145	601199	江南水务	7,650,499.00	4.95
146	300303	聚飞光电	7,620,019.94	4.93
147	603686	龙马环卫	7,517,731.06	4.87
148	000652	泰达股份	7,379,389.91	4.78
149	603699	纽威股份	7,356,724.46	4.76
150	002638	勤上光电	7,237,577.44	4.69
151	300028	金亚科技	7,198,300.00	4.66
152	000852	石化机械	7,042,313.00	4.56
153	000598	兴蓉环境	6,919,687.00	4.48
154	300037	新宙邦	6,905,234.24	4.47
155	000920	南方汇通	6,783,199.26	4.39
156	000605	渤海股份	6,780,193.80	4.39
157	002466	天齐锂业	6,707,996.76	4.34
158	600260	凯乐科技	6,683,897.30	4.33
159	300080	易成新能	6,648,103.03	4.30
160	300207	欣旺达	6,527,228.14	4.23
161	300437	清水源	6,505,321.40	4.21
162	002531	天顺风能	6,256,183.62	4.05
163	002334	英威腾	6,137,571.40	3.97
164	300118	东方日升	6,130,073.98	3.97
165	300326	凯利泰	6,042,811.65	3.91
166	002130	沃尔核材	5,899,060.56	3.82
167	300083	劲胜精密	5,869,214.40	3.80
168	300310	宜通世纪	5,792,708.45	3.75
169	600271	航天信息	5,777,657.16	3.74
170	002758	华通医药	5,764,512.00	3.73
171	002364	中恒电气	5,745,286.00	3.72
172	300152	科融环境	5,687,606.20	3.68
173	601877	正泰电器	5,674,053.50	3.67
174	600584	长电科技	5,650,287.00	3.66
175	300323	华灿光电	5,541,540.00	3.59
176	002341	新纶科技	5,520,230.80	3.57
177	000002	万科A	5,365,732.00	3.47
178	601158	重庆水务	5,355,799.48	3.47
179	002183	怡亚通	5,268,557.76	3.41
180	000786	北新建材	5,242,774.31	3.39
181	002117	东港股份	5,160,255.00	3.34
182	300351	永贵电器	5,129,096.30	3.32

183	002123	荣信股份	5,114,003.30	3.31
184	601808	中海油服	5,109,312.00	3.31
185	601599	鹿港科技	5,067,053.00	3.28
186	300190	维尔利	5,009,906.32	3.24
187	600236	桂冠电力	4,876,831.59	3.16
188	600579	天华院	4,729,180.72	3.06
189	000777	中核科技	4,681,924.58	3.03
190	002572	索菲亚	4,608,046.00	2.98
191	300334	津膜科技	4,599,603.15	2.98
192	000651	格力电器	4,596,204.00	2.98
193	600617	国新能源	4,570,830.00	2.96
194	603118	共进股份	4,552,985.00	2.95
195	600886	国投电力	4,547,047.00	2.94
196	300012	华测检测	4,520,465.41	2.93
197	000538	云南白药	4,512,000.00	2.92
198	300263	隆华节能	4,465,008.83	2.89
199	601368	绿城水务	4,461,319.51	2.89
200	601908	京运通	4,308,020.92	2.79
201	600522	中天科技	4,289,353.42	2.78
202	002013	中航机电	4,277,520.00	2.77
203	603568	伟明环保	4,167,475.73	2.70
204	601139	深圳燃气	4,093,393.28	2.65
205	300137	先河环保	4,092,037.00	2.65
206	002351	漫步者	4,064,874.00	2.63
207	601699	潞安环能	4,054,700.00	2.62
208	300262	巴安水务	3,933,395.00	2.55
209	601688	华泰证券	3,881,002.00	2.51
210	002717	岭南园林	3,630,672.40	2.35
211	002318	久立特材	3,468,013.06	2.25
212	002080	中材科技	3,451,921.50	2.23
213	603308	应流股份	3,405,967.57	2.20
214	300230	永利股份	3,336,730.10	2.16
215	000970	中科三环	3,328,324.78	2.15
216	002309	中利科技	3,323,991.00	2.15
217	601016	节能风电	3,306,896.04	2.14
218	300425	环能科技	3,268,311.00	2.12
219	000567	海德股份	3,259,926.00	2.11
220	600526	菲达环保	3,229,545.00	2.09

221	002203	海亮股份	3,191,127.22	2.07
222	600021	上海电力	3,160,636.00	2.05
223	600098	广州发展	3,100,828.00	2.01

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,600,842,478.66
卖出股票收入（成交）总额	3,349,915,307.46

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：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

## 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

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、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	549,220.55
2	应收证券清算款	11,798,279.64
3	应收股利	-
4	应收利息	21,840.55
5	应收申购款	1,574,408.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,943,749.60

### 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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
19,396	18,432.69	115,733,437.69	32.37%	241,787,083.32	67.63%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	86,776.82	0.0243%

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

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年3月7日）基金份额总额	841,094,897.79
本报告期期初基金份额总额	141,211,519.33
本报告期基金总申购份额	1,289,977,999.20
减：本报告期基金总赎回份额	1,073,668,997.52
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-

本报告期末基金份额总额	357,520,521.01
-------------	----------------

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 报告期内基金管理人的重大人事变动：

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

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

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

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

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

11.2.2 报告期内基金托管人的重大人事变动：

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

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

## 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期基金投资策略未改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 56,000.00 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	
中投证券	2	3,188,130,030.43	45.87%	2,861,429.76	45.88%	-
国信证券	1	1,606,379,966.04	23.11%	1,440,354.73	23.09%	-
平安证券	2	368,960,532.44	5.31%	335,697.32	5.38%	-
中航证券	2	306,614,745.19	4.41%	271,323.47	4.35%	本报告期内新增
招商证券	1	289,259,001.81	4.16%	258,060.70	4.14%	本报告期内新增
光大证券	1	210,827,355.12	3.03%	192,127.12	3.08%	本报告期内新增
安信证券	2	182,720,578.10	2.63%	163,404.00	2.62%	本报告期内新增
中信建投	2	178,765,519.16	2.57%	160,245.57	2.57%	本报告期内新增
海通证券	1	168,462,422.86	2.42%	150,550.65	2.41%	-
方正证券	1	107,365,154.98	1.54%	96,181.97	1.54%	-
中金公司	1	105,184,559.55	1.51%	94,021.99	1.51%	本报告期内新增
华西证券	1	99,661,599.48	1.43%	88,527.69	1.42%	本报告期内新增
东方证券	1	54,514,680.29	0.78%	49,679.34	0.80%	本报告期内新增
国泰君安	2	48,477,743.43	0.70%	42,978.35	0.69%	-
广发证券	1	35,380,983.13	0.51%	32,242.58	0.52%	本报告期内新增
长江证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
兴业证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
华创证券	1	-	-	-	-	-

中泰证券	2	-	-	-	-	本报告期内新增
湘财证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
宏源证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
中信证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
银河证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增

注：交易单元选择的标准和程序

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

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生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
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询  
服务。

2、选择交易单元的程序：

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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

鹏华基金管理有限公司  
2016 年 3 月 30 日