

# 鹏华文化传媒娱乐股票型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：2016 年 8 月 29 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 2016 年 8 月 24 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 2016 年 1 月 27 日(基金合同生效日)起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
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.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	41

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
8.3 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.....	43
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>43</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	47
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>54</b>
11.1 备查文件目录.....	54
11.2 存放地点.....	54
11.3 查阅方式.....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华文化传媒娱乐股票型证券投资基金
基金简称	鹏华文化传媒娱乐股票
场内简称	-
基金主代码	001223
交易代码	001223
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 27 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	68,754,733.83 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型基金，在有效控制风险前提下，精选文化传媒娱乐业相关的优质上市公司，分享其发展和成长的机会，力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量(包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)以及各项国家政策(包括财政、货币、税收、汇率政策等)来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1) 自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2) 自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。</p> <p>(1) 文化传媒娱乐业的定义</p> <p>文化传媒娱乐业包括文化娱乐制品、文化娱乐传播服务和文化休闲娱乐活动等领域的产品制作、营销策划、产品运营、以及相关的软硬件提供商等产业链上下游的企业。具体来说，涵盖电影电视、动漫游戏、新闻</p>

传播、文化教育、体育竞技、旅游休闲、广告会展、互联网以及相对应的软、硬件提供商等相关产业。除上述行业之外，如果某些细分行业和公司同样符合传媒娱乐业的定义，本基金也会酌情将其纳入传媒娱乐业的投资范围。

未来如果基金管理人认为有更适当的文化传媒娱乐业划分标准，基金管理人有权对文化传媒娱乐业的界定方法进行变更。本基金由于上述原因变更文化传媒娱乐业的界定方法不需经基金份额持有人大会通过，但应及时告知基金托管人并公告。

若因基金管理人界定文化传媒娱乐业的方法调整或者上市公司经营发生变化等原因导致本基金持有的文化传媒娱乐业相关的股票的比例低于非现金基金资产的 80%，本基金将在三十个交易日之内进行调整。

#### (2) 自上而下的行业遴选

本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。

#### (3) 自下而上的个股选择

本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，精选优质个股。

##### 1) 定性分析

本基金通过以下两方面标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出优质的上市公司：

一方面是竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的上市公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有核心竞争力，并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。

另一方面是管理层分析，通过着重考察公司的管理层以及管理制度，选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。

##### 2) 定量分析

本基金通过对上市公司定量的估值分析，挖掘优质的投资标的。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行

	<p>业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法（包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等）；就估值倍数而言，通过业内比较、历史比较和增长性分析，确定具有上升基础的股价水平。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p> <p>4、权证投资策略</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> <p>5、中小企业私募债投资策略</p> <p>中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。</p>
业绩比较基准	中证传媒指数收益率×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	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	<a href="http://www.phfund.com">http://www.phfund.com</a>
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	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

## § 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(2016 年 1 月 27 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	14,031,519.44
本期利润	16,138,126.90
加权平均基金份额本期利润	0.1317
本期加权平均净值利润率	12.64%
本期基金份额净值增长率	10.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	7,381,234.19
期末可供分配基金份额利润	0.1074
期末基金资产净值	76,135,968.02
期末基金份额净值	1.107



3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	10.70%

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。

(4) 本基金基金合同于2016年1月27日生效，至2016年6月30日未满6个月。

## 3.2 基金净值表现

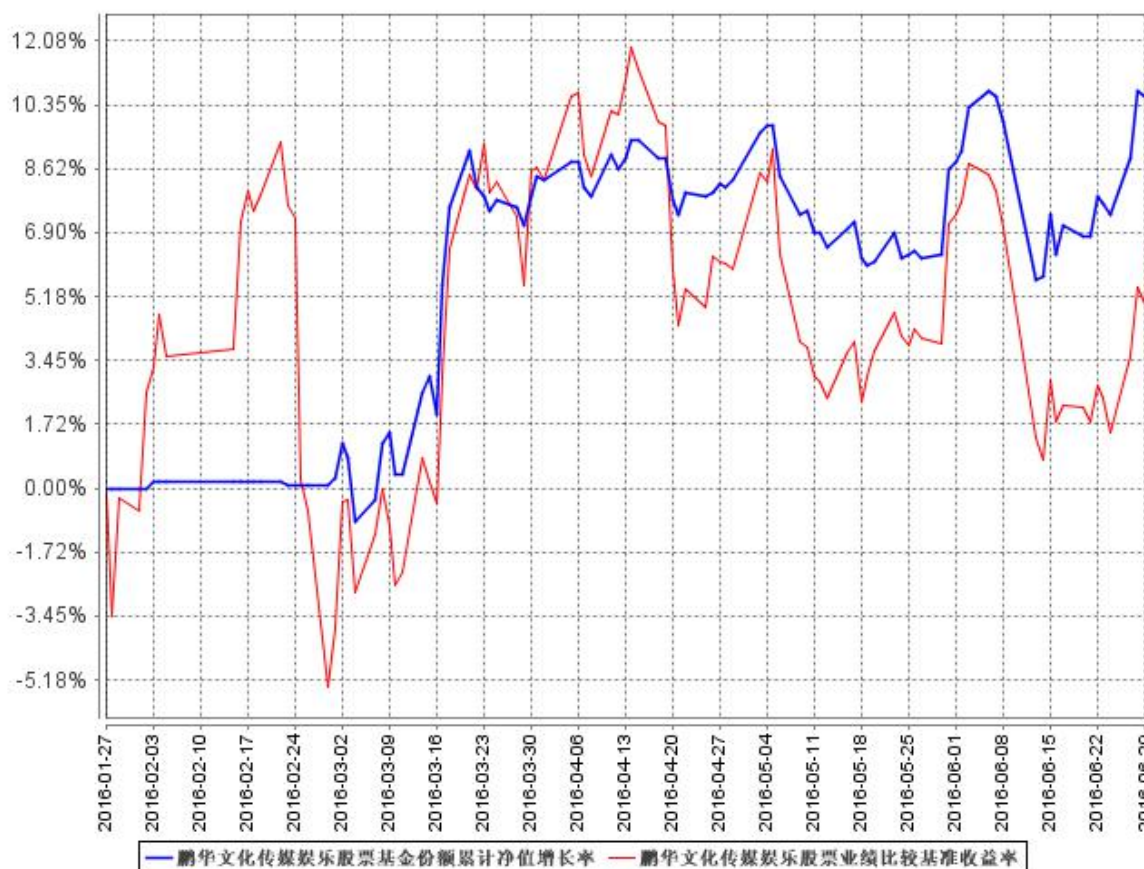
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.93%	1.19%	-0.68%	1.59%	2.61%	-0.40%
过去三个月	2.12%	0.84%	-2.04%	1.38%	4.16%	-0.54%
自基金合同生效起至今	10.70%	0.86%	6.44%	1.76%	4.26%	-0.90%

注：业绩比较基准=中证传媒指数收益率\*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

鹏华文化传媒娱乐股票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 2016 年 1 月 27 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。  
2、本基金管理人将严格按照本基金合同的约定，于本基金建仓期届满后确保各项投资比例符合基金合同的约定。

## § 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 2016 年 6 月，公司管理资产总规模达到 3609.67 亿

元，管理 99 只公募基金、10 只全国社保投资组合。经过近 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		
谢书英	本基金基金经理	2016 年 1 月 27 日	-	8	谢书英女士，国籍中国，经济学硕士，8 年证券从业经验。曾任职于高盛高华证券有限公司投资银行部；2009 年 4 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任研究部高级研究员、投资经理助理，从事行业研究及投资助理相关工作，2014 年 4 月起担任鹏华金刚保本混合基金基金经理，2015 年 6 月起兼任鹏华价值优势混合（LOF）基金基金经理，2016 年 1 月起兼任鹏华文化传媒娱乐股票基金基金经理。谢书英女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。本基金为本期新成立基金。

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、分配等

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

上半年传媒板块表现整体不佳，作为一只以战胜行业基准为目标的行业基金，上半年也面临较大的压力。所幸上半年基金处于建仓期内，可以通过较为灵活的仓位选择，抵御部分行业的不佳表现。

### 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 10.70%，同期上证综指下跌 17.22%，深证成指下跌 17.17%，沪深 300 指数下跌 15.47%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，行业整体偏高的估值水平依然将制约行业下半年的整体表现。但一些成长性相对明确的优质公司已经逐步体现出估值上的优势，我们认为这些公司下半年的表现将好于行业。同时，我们也密切关注行业的新热点、新动向，积极寻找主题性的投资机会。

## 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

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 7,381,234.19 元，期末基金份额净值 1.107 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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：鹏华文化传媒娱乐股票型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	9,452,439.58
结算备付金		240,221.03
存出保证金		66,032.73
交易性金融资产	6.4.7.2	52,004,797.11
其中：股票投资		52,004,797.11
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		15,148,829.18
应收利息	6.4.7.5	5,326.42
应收股利		-
应收申购款		351,967.81
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		77,269,613.86
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>
<b>负债：</b>		

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		-
应付赎回款		763,521.37
应付管理人报酬		95,847.68
应付托管费		15,974.60
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	109,951.05
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	148,351.14
负债合计		1,133,645.84
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	68,754,733.83
未分配利润	6.4.7.10	7,381,234.19
所有者权益合计		76,135,968.02
负债和所有者权益总计		77,269,613.86

注：(1) 报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.107 元，基金份额总额 68,754,733.83 份。

(2) 本基金基金合同于 2016 年 1 月 27 日生效，无上年度末数据。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华文化传媒娱乐股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 27 日(基金合同生 效日)至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		17,706,937.51
1.利息收入		318,416.57
其中：存款利息收入	6.4.7.11	315,497.83
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,918.74
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		14,281,987.01

其中：股票投资收益	6.4.7.12	14,138,249.75
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	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	143,737.26
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,106,607.46
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	999,926.47
<b>减：二、费用</b>		<b>1,568,810.61</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	815,550.34
2. 托管费	6.4.10.2.2	135,925.02
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	466,505.77
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	150,829.48
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>16,138,126.90</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>16,138,126.90</b>

注：(1)报告实际编制期间为 2016 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日。

(2)本基金基金合同于 2016 年 1 月 27 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华文化传媒娱乐股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 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)	245,582,148.39	0.00	245,582,148.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0.00	16,138,126.90	16,138,126.90
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)	-176,827,414.56	-8,756,892.71	-185,584,307.27



其中：1.基金申购款	29,743,688.21	2,044,409.42	31,788,097.63
2.基金赎回款	-206,571,102.77	-10,801,302.13	-217,372,404.90
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）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	68,754,733.83	7,381,234.19	76,135,968.02

注：(1)报告实际编制期间为 2016 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日。

(2)本基金基金合同于 2016 年 1 月 27 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鹏华文化传媒娱乐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[2015]574号《关于准予鹏华文化传媒娱乐股票型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《鹏华文化传媒娱乐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人民币 245,496,373.77 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(2016)第 096 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华文化传媒娱乐股票型证券投资基金基金合同》于 2016 年 1 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 245,582,148.39 份基金份额,其中认购资金利息折合 85,774.62 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《鹏华文化传媒娱乐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,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金的比例为 80%

—95%；投资于文化传媒娱乐业相关的股票占非现金资产的比例不低于 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，基金保留的现金以及投资于到期日在一年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：中证传媒指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%。

#### 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(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》、《鹏华文化传媒娱乐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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日止期间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 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日止期间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 2016 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币,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。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(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或资产支持证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：(4.1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(4.2) 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(4.3) 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、资产支持证券和衍生工具(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损益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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、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《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》

提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现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，根据中国证监会证监会字[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[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》[适用于 CEF]/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》[适用于 OEF]、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，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，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。

## 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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	9,452,439.58

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	9,452,439.58

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	49,898,189.65	52,004,797.11	2,106,607.46
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	49,898,189.65	52,004,797.11	2,106,607.46

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 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：无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	5,188.62
应收定期存款利息	0.00
应收其他存款利息	0.00
应收结算备付金利息	108.10



应收债券利息	0.00
应收买入返售证券利息	0.00
应收申购款利息	0.00
应收黄金合约拆借孳息	0.00
其他	29.70
合计	5,326.42

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	109,951.05
银行间市场应付交易费用	-
合计	109,951.05

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,527.06
预提费用	146,824.08
合计	148,351.14

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月27日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	245,582,148.39	245,582,148.39
本期申购	29,743,688.21	29,743,688.21
本期赎回(以“-”号填列)	-206,571,102.77	-206,571,102.77
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-

本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	68,754,733.83	68,754,733.83

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 2016 年 1 月 5 日至 2016 年 1 月 22 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 245,496,373.77 元。根据《鹏华文化传媒娱乐股票型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 85,774.62 元在本基金成立后，折算为 85,774.62 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

#### 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	14,031,519.44	2,106,607.46	16,138,126.90
本期基金份额交易产生的变动数	-5,979,652.32	-2,777,240.39	-8,756,892.71
其中：基金申购款	2,435,871.87	-391,462.45	2,044,409.42
基金赎回款	-8,415,524.19	-2,385,777.94	-10,801,302.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,051,867.12	-670,632.93	7,381,234.19

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	306,749.09
定期存款利息收入	0.00
其他存款利息收入	0.00
结算备付金利息收入	1,845.63
其他	6,903.11
合计	315,497.83

注：其他为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	143,640,008.16
减：卖出股票成本总额	129,501,758.41
买卖股票差价收入	14,138,249.75

**6.4.7.13 债券投资收益**

无。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

无。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月27日(基金合同生效日)至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	143,737.26
基金投资产生的股利收益	-
合计	143,737.26

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月27日(基金合同生效日)至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	2,106,607.46
——股票投资	2,106,607.46
——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	2,106,607.46

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月27日(基金合同生效日)至2016年6月30日

基金赎回费收入	997,227.65
转换费收入	2,698.82
合计	999,926.47

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月27日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
交易所市场交易费用	466,505.77
银行间市场交易费用	-
合计	466,505.77

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月27日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
审计费用	22,941.36
信息披露费	123,882.72
其他	400.00
账户维护费	360.00
银行汇划费用	3,245.40
合计	150,829.48

### 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(“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

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。

##### 6.4.10.1 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 2016年1月27日(基金合同生效日)至2016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	73,509,228.27	22.77%

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

###### 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 2016年1月27日(基金合同生效日)至2016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	66,989.02	22.77%	17,601.70	16.01%

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 2016年1月27日(基金合同生效日)至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	815,550.34
其中：支付销售机构的客户维护费	479,013.70

注：（1）支付基金管理人鹏华基金管理公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=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。

（3）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。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月27日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	135,925.02

注：1、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。

2、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。

## 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

## 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：本基金本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未投资、持有本基金。

#### 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：本基金本报告期除基金管理人之外的其他关联方未投资、持有本基金，上年度末无数据。

#### 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 2016年1月27日(基金合同生效日) 至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	9,452,439.58	306,749.09	-	-

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：本基金本报告期没有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（2016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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	863	5,005.40	5,005.40	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	469	4,713.45	4,713.45	-

##### 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
601611	中国核建	2016年6月30日	临时停牌	20.92	2016年7月1日	23.01	2,218	7,696.46	46,400.56	-

		日			日				
--	--	---	--	--	---	--	--	--	--

### 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

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 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

本基金为股票型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

### 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制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。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同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

感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，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 2016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	9,452,439.58	-	-	-	9,452,439.58
结算备付金	240,221.03	-	-	-	240,221.03
存出保证金	66,032.73	-	-	-	66,032.73
交易性金融资产	-	-	-	52,004,797.11	52,004,797.11
应收证券清算款	-	-	-	15,148,829.18	15,148,829.18
应收利息	-	-	-	5,326.42	5,326.42
应收申购款	-	-	-	351,967.81	351,967.81
资产总计	9,758,693.34	-	-	67,510,920.52	77,269,613.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	763,521.37	763,521.37
应付管理人报酬	-	-	-	95,847.68	95,847.68
应付托管费	-	-	-	15,974.60	15,974.60
应付交易费用	-	-	-	109,951.05	109,951.05
其他负债	-	-	-	148,351.14	148,351.14
负债总计	-	-	-	1,133,645.84	1,133,645.84
利率敏感度缺口	9,758,693.34	-	-	66,377,274.68	76,135,968.02

注：(1)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。

(2)本基金基金合同于2016年1月27日生效，无上年度末数据。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于2016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。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产占基金资产的比例为 80%—95%；投资于文化传媒娱乐业上市公司发行的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	52,004,797.11	68.31	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	52,004,797.11	68.31	-	-

#### 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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	1,386,350.58	0.00

	业绩比较基准下降 5%	-1,386,350.58	0.00
--	-------------	---------------	------

注：于 2016 年 6 月 30 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此，无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

#### 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	52,004,797.11	67.30
	其中：股票	52,004,797.11	67.30
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	9,692,660.61	12.54
7	其他各项资产	15,572,156.14	20.15
8	合计	77,269,613.86	100.00

### 7.2 期末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	9,487,991.19	12.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	46,400.56	0.06
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	10,606,767.50	13.93
J	金融业	4,598,473.74	6.04
K	房地产业	2,418,300.00	3.18
L	租赁和商务服务业	7,991,645.31	10.50
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	16,855,218.81	22.14
S	综合	-	-
	合计	52,004,797.11	68.31

### 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

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	002400	省广股份	436,579	6,168,861.27	8.10
2	002343	慈文传媒	105,432	5,113,452.00	6.72
3	000892	星美联合	254,764	3,604,910.60	4.73
4	300251	光线传媒	308,800	3,569,728.00	4.69
5	000404	华意压缩	310,412	2,986,163.44	3.92
6	300144	宋城演艺	106,041	2,641,481.31	3.47
7	300133	华策影视	160,900	2,505,213.00	3.29
8	601998	中信银行	402,400	2,281,608.00	3.00
9	601988	中国银行	709,000	2,275,890.00	2.99
10	601098	中南传媒	122,400	2,216,664.00	2.91
11	300059	东方财富	91,600	2,033,520.00	2.67
12	600138	中青旅	94,347	1,822,784.04	2.39
13	300383	光环新网	45,600	1,728,240.00	2.27
14	300033	同花顺	20,700	1,686,015.00	2.21
15	002425	凯撒股份	75,672	1,664,784.00	2.19
16	001979	招商蛇口	115,200	1,641,600.00	2.16
17	300199	翰宇药业	76,000	1,546,600.00	2.03

18	300031	宝通科技	60,400	1,541,408.00	2.02
19	002131	利欧股份	89,900	1,536,391.00	2.02
20	300241	瑞丰光电	90,400	1,492,504.00	1.96
21	002624	完美环球	21,422	808,680.50	1.06
22	600048	保利地产	90,000	776,700.00	1.02
23	603737	三棵树	442	51,307.36	0.07
24	601611	中国核建	2,218	46,400.56	0.06
25	300516	久之洋	245	42,916.65	0.06
26	002797	第一创业	1,014	40,975.74	0.05
27	300515	三德科技	813	38,105.31	0.05
28	300512	中亚股份	369	36,870.48	0.05
29	603131	上海沪工	589	35,752.30	0.05
30	002799	环球印务	648	28,278.72	0.04
31	300518	盛讯达	277	12,977.45	0.02
32	002802	洪汇新材	804	12,124.32	0.02
33	603008	喜临门	359	6,171.21	0.01
34	002805	丰元股份	863	5,005.40	0.01
35	300520	科大国创	469	4,713.45	0.01

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002400	省广股份	15,961,292.21	20.96
2	002624	完美环球	13,002,993.17	17.08
3	300059	东方财富	11,559,383.92	15.18
4	002131	利欧股份	10,817,100.50	14.21
5	002343	慈文传媒	10,453,986.00	13.73
6	300017	网宿科技	9,341,319.90	12.27
7	300144	宋城演艺	9,183,948.89	12.06
8	002117	东港股份	5,539,558.00	7.28
9	600386	北巴传媒	5,533,036.70	7.27
10	300251	光线传媒	5,483,537.32	7.20
11	600011	XD 华能国	5,371,714.00	7.06
12	601166	兴业银行	4,576,268.00	6.01

13	601988	中国银行	4,531,335.00	5.95
14	600138	中青旅	3,757,340.56	4.94
15	300291	华录百纳	3,756,397.00	4.93
16	000892	星美联合	3,745,562.16	4.92
17	000418	小天鹅 A	3,737,292.18	4.91
18	002673	西部证券	3,697,621.29	4.86
19	002286	保龄宝	3,693,166.87	4.85
20	002517	恺英网络	3,581,961.00	4.70
21	603008	喜临门	3,424,320.80	4.50
22	000404	华意压缩	3,261,368.00	4.28
23	300133	华策影视	2,421,192.00	3.18
24	600771	广誉远	2,287,084.00	3.00
25	601088	中国神华	2,281,848.00	3.00
26	002271	东方雨虹	2,270,472.00	2.98
27	601998	中信银行	2,268,531.00	2.98
28	601098	中南传媒	2,182,198.00	2.87
29	001979	招商蛇口	1,672,188.35	2.20
30	000681	视觉中国	1,645,859.65	2.16
31	002425	凯撒股份	1,643,200.26	2.16
32	600797	浙大网新	1,642,992.00	2.16
33	300383	光环新网	1,638,597.00	2.15
34	300033	同花顺	1,638,345.00	2.15
35	300058	蓝色光标	1,607,017.74	2.11
36	300031	宝通科技	1,536,713.00	2.02
37	300241	瑞丰光电	1,524,413.00	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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002624	完美环球	13,871,424.01	18.22
2	002400	省广股份	12,008,478.13	15.77
3	300059	东方财富	11,316,250.38	14.86
4	002131	利欧股份	10,538,648.97	13.84
5	300017	网宿科技	10,260,556.57	13.48
6	002343	慈文传媒	7,708,128.65	10.12

7	300144	宋城演艺	7,341,531.75	9.64
8	002117	东港股份	7,217,154.32	9.48
9	600386	北巴传媒	5,905,767.25	7.76
10	600011	XD 华能国	5,263,978.78	6.91
11	601166	兴业银行	4,590,848.71	6.03
12	000418	小天鹅A	4,471,802.35	5.87
13	300291	华录百纳	4,300,934.32	5.65
14	002286	保龄宝	4,144,803.60	5.44
15	002517	恺英网络	3,898,520.12	5.12
16	002673	西部证券	3,552,857.00	4.67
17	603008	喜临门	3,054,294.97	4.01
18	600771	广誉远	2,336,464.16	3.07
19	002271	东方雨虹	2,277,826.75	2.99
20	601988	中国银行	2,216,090.00	2.91
21	601088	中国神华	2,149,897.00	2.82
22	600138	中青旅	2,006,827.29	2.64
23	300251	光线传媒	1,984,457.76	2.61
24	300058	蓝色光标	1,690,012.36	2.22
25	000783	长江证券	1,658,115.21	2.18
26	600797	浙大网新	1,600,217.52	2.10
27	000681	视觉中国	1,524,214.00	2.00

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	179,399,948.06
卖出股票收入（成交）总额	143,640,008.16

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：无。

#### 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：无。

#### 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：无。



## 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：无。

## 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：无。

## 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：无。

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

## 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

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 7.11.2 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星美联合在 5 月 17 日发布《关于本次重大资产重组的审计机构被立案调查的风险提示公告》。公告指出，2016 年 5 月 13 日，中国证券监督管理委员会召开的新闻发布会通报了 6 家审计和评估机构被中国证监会立案调查的情况，其中之一的北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)正是星美联合股份有限公司本次重大资产重组事项的审计机构。2016 年 5 月 16 日，星美联合通过本次重大资产重组标的资产方欢瑞世纪影视传媒股份有限公司向北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)进行了核实。核实情况：北京兴华会计师事务所于 2016 年 5 月 11 日接到中国证券监督管理委员会调查通知书(深证调查通字 16051 号)，因涉嫌违反证券法律法规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，决定对该所立案调查。

根据公司公告，公司从兴华会计获悉，该所为本次重大资产重组标的资产提供审计服务的邹志文先生、贾俊伟先生并未被立案调查或被采取监管措施，也没有参与被立案调查的相关项目。

按照《上市公司监管法律法规常见问题与解答修订汇编》中关于“中介机构被立案调查是否影响上市公司并购重组行政许可的受理”的解答，审计机构、评估机构被立案调查的，不会影响中国证监会受理其出具的财务报告、评估报告等文件，但在审核中将重点关注其诚信信息及执业状况。本基金管理长期跟踪研究该股票，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。

### 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	66,032.73
2	应收证券清算款	15,148,829.18
3	应收股利	-
4	应收利息	5,326.42
5	应收申购款	351,967.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,572,156.14

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

### 7.12.6 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。

## § 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

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
1,916	35,884.52	4,999,000.0	7.27%	63,755,733.83	92.73%

### 8.2 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	4,343.08	0.0063%

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。

### 8.3 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：（1）本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人本报告期末未持有本基金份额。  
（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

基金合同生效日（2016年1月27日）基金份额总额	245,582,148.39
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	29,743,688.21
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	206,571,102.77
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份 额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	68,754,733.83

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。

## § 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

#### 10.2.1 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。

#### 10.2.2 基金托管人的重大人事变动:

基金托管人本报告期无重大人事变动。

### 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	
中金公司	2	143,875,556.87	44.56%	131,113.77	44.56%	本报告期新增
国信证券	2	73,509,228.27	22.77%	66,989.02	22.77%	本报告期新增
海通证券	2	33,702,080.98	10.44%	30,712.61	10.44%	本报告期新增
中航证券	2	26,653,483.76	8.26%	24,289.27	8.26%	本报告期新增
安信证券	2	16,619,504.02	5.15%	15,145.44	5.15%	本报告期新增
国泰君安	2	14,656,227.99	4.54%	13,356.29	4.54%	本报告期新增
长城证券	1	10,086,482.54	3.12%	9,191.53	3.12%	本报告期新增
中信证券	1	3,757,340.56	1.16%	3,424.00	1.16%	本报告期新增
宏源证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
湘财证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
光大证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
东方证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
中信建投	2	-	-	-	-	本报告期新增
广发证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
长江证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
平安证券	2	-	-	-	-	本报告期新增
华创证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
招商证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
银河证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
华西证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
东方财富证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
兴业证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
中泰证券	2	-	-	-	-	本报告期新增
方正证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
中投证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
国金证券	1	-	-	-	-	本报告期新增

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**

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
中金公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	15,000,000.00	100.00%	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

## 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	鹏华基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月5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》	2016年1月5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》	2016年1月6日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月6日
5	鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金更新的招募说明书摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月7日
6	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月8日

	变更的提示性公告	报》	
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》	2016 年 1 月 9 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》	2016 年 1 月 12 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》	2016 年 1 月 14 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》	2016 年 1 月 16 日
11	2015 年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 21 日
12	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》	2016 年 1 月 21 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》	2016 年 1 月 22 日
14	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》	2016 年 1 月 26 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》	2016 年 1 月 27 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《上	2016 年 1 月 28 日



	基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	海证券报》、《证券时报》	
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》	2016 年 1 月 29 日
18	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》	2016 年 1 月 29 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》	2016 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》	2016 年 2 月 23 日
21	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔申购最低金额及赎回持有最低份额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 2 月 24 日
22	关于旗下基金所持金亚科技（300028）估值调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 2 月 24 日
23	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》	2016 年 2 月 26 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》	2016 年 2 月 27 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》	2016 年 3 月 1 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》	2016 年 3 月 3 日
27	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与光大证券网上交易和手机客户端申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 10 日
28	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》	2016 年 3 月 14 日
29	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》	2016 年 3 月 19 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》	2016 年 3 月 22 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》	2016 年 3 月 24 日
32	关于旗下基金所持沃森生物(300142) 估值调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 29 日
33	2015 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 30 日
34	鹏华基金管理有限公司关于增加中国中投证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 31 日
35	鹏华基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《上	2016 年 4 月 6 日

	基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	海证券报》、《证券时报》	
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》	2016 年 4 月 7 日
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中投证券网上交易和现场柜台申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 7 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》	2016 年 4 月 12 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》	2016 年 4 月 14 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》	2016 年 4 月 14 日
41	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海陆金所资产管理有限公司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》	2016 年 4 月 18 日
42	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与招商证券网上交易、手机客户端和现场柜台申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 18 日
43	鹏华基金管理有限公司关于增加招商证券股份有限公司为旗下部	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 18 日

	分基金销售机构的公告	报》	
44	2016 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 20 日
45	鹏华基金管理有限公司关于增加江苏江南农村商业银行股份有限公司为旗下部分开放式基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 20 日
46	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》	2016 年 4 月 21 日
47	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》	2016 年 4 月 22 日
48	鹏华基金管理有限公司关于增加第一创业证券股份有限公司为我司旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 3 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》	2016 年 5 月 5 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》	2016 年 5 月 10 日
51	鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 10 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》	2016 年 5 月 11 日

53	鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 20 日
54	鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 26 日
55	鹏华基金管理有限公司关于增加中国民族证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 30 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》	2016 年 6 月 1 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》	2016 年 6 月 8 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》	2016 年 6 月 14 日
59	鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 6 月 15 日
60	鹏华基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户的证件类型公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 6 月 18 日
61	鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 6 月 24 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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 6 月 28 日

	变更的提示性公告	报》	
63	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购手续费费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 6 月 30 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (一)《鹏华文化传媒娱乐股票型证券投资基金基金合同》;
- (二)《鹏华文化传媒娱乐股票型证券投资基金托管协议》;
- (三)《鹏华文化传媒娱乐股票型证券投资基金 2016 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  
2016 年 8 月 29 日