

鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2012 年半年度报告

2012 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2012 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 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 2012 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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
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.....	9
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.....	9
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.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	13
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	29
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.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	45
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	46
7.9 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47

§9 开放式基金份额变动	47
§10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	49
§11 备查文件目录	50
11.1 备查文件目录.....	50
11.2 存放地点.....	50
11.3 查阅方式.....	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	鹏华中证 500 指数 (LOF)
基金主代码	160616
交易代码	160616
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2010 年 2 月 5 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,339,349,345.26 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	2010-04-28

注：本基金在交易所行情系统净值提示等其他信息披露场合下，可简称为“鹏华 500”。

2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资方式，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以实现中证 500 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法，原则上按照成份股在中证 500 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责 人	姓名	张戈	赵会军
	联系电话	0755-82825720	010-66105799
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105798
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	际商会中心第 43 层	
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	何如	姜建清

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.cn
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第 43 层鹏华基金管理有限公司

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(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-71,757,566.58
本期利润	55,195,128.94
加权平均基金份额本期利润	0.0396
本期加权平均净值利润率	5.27%
本期基金份额净值增长率	5.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-364,477,751.28
期末可供分配基金份额利润	-0.2721
期末基金资产净值	974,871,593.98
期末基金份额净值	0.728
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-27.20%

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

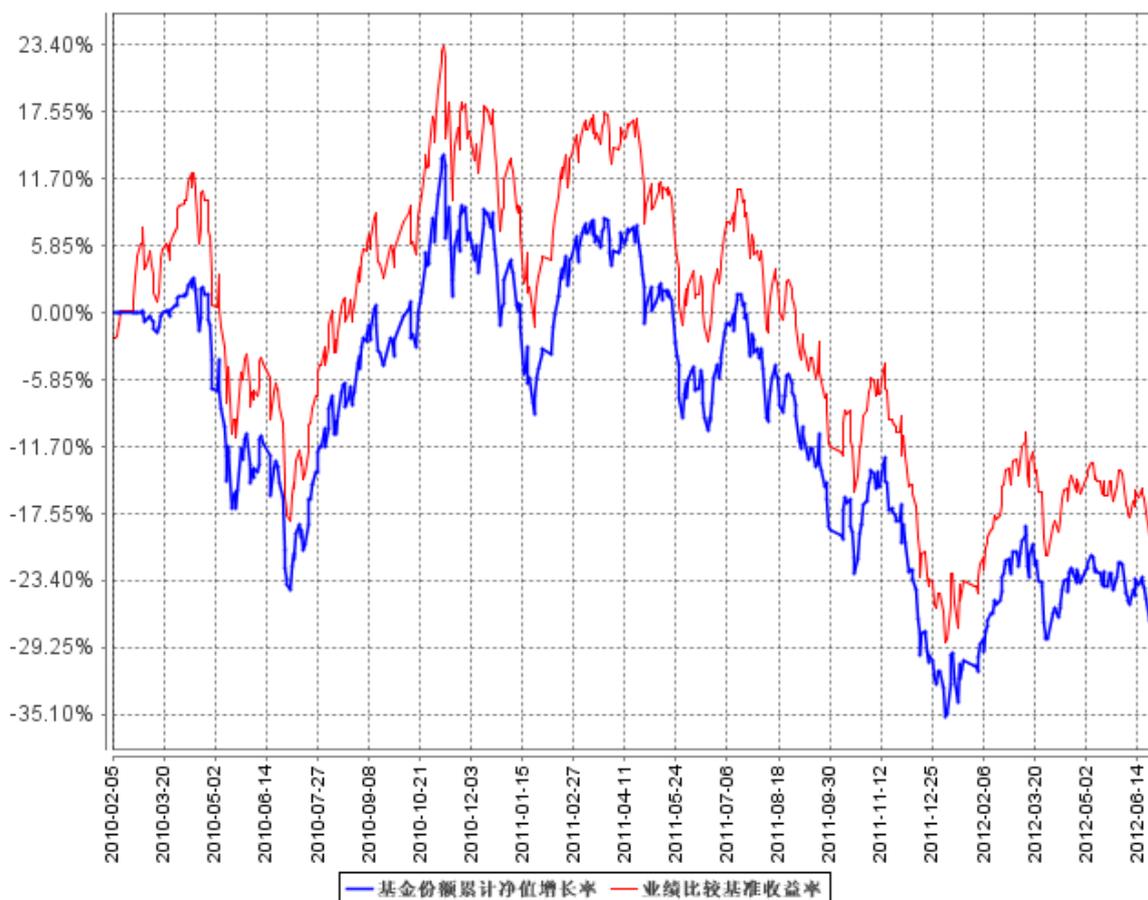
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-6.91%	1.18%	-7.16%	1.18%	0.25%	0.00%
过去三个月	1.82%	1.17%	1.53%	1.16%	0.29%	0.01%
过去六个月	5.97%	1.52%	6.02%	1.53%	-0.05%	-0.01%
过去一年	-23.85%	1.52%	-23.00%	1.53%	-0.85%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-27.20%	1.54%	-19.95%	1.57%	-7.25%	-0.03%

注：本基金业绩比较基准=中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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、鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同于 2010 年 2 月 5 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。

§ 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 2 只封闭式基金、27 只开放式基金和 6 只社保组合, 经过 13 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		
方南	本基金基金经理	2010 年 2 月 5 日	-	10	方南先生, 国籍中国, 工商管理硕士, 10 年证券从业经验。曾任职于杭州恒生电子股份有限公司, 上海新利多数字技术有限公司。2001 年 11 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任金融工程部 (原) 研究员、金融工程部 (原) 总经理助理、鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理助理。2010 年 2 月至今担任鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2010 年 8 月至今兼任鹏华上证民企 50ETF 基金及其联接基金基金经理, 2011 年 9 月起兼任鹏华深证民营 ETF 基金及其联接基金基金经理。方南先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定, 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并对基金财产造成损失的异常交易行为, 未存在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% 的异常交易行为。

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

年初, 短期内通胀、房地产价格等结构性矛盾、风险较前期有所缓和, 在数据上给政府的政策微调打下了基础和提供了可能性, 也给市场带来了较为乐观的预期, 从而迎来了一定的上涨。

然而随着经济数据的不断确认, 经济增速的回落已成事实, 与此对应的是, A 股市场估值中枢下移。前期我们关注的需求能否逐步启动并带动新的库存周期和增长动能在二季度仍未得到明显确认。市场预期相对于股市的提前量及博弈氛围有所降低, 结构性机会在进行较长时间的市场抉择和参与后并未有实质性中枢行业支撑, 市场整体缺乏上涨动力、回调压力逐步增大。

在此期间, 市场整体处于震荡状态, 单日波动保持较高程度, 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 0.728 元, 累计净值 0.728 元; 本报告期基金份额净值增长率为 5.97%, 同期业绩比较基准收益率为 6.02%。

报告期内, 本基金日均跟踪偏离度的绝对值 0.001%, 年化跟踪误差 0.908%, 较好的完成了跟踪目标。

对本基金而言, 本期间跟踪误差的主要来源主要有三个方面: 一是样本股调整, 对此, 我们采取了“优化”策略以应对, 取得了较好的效果; 二是本期基金面临了一定的申赎变动, 而当时

市场单日波幅较大, 对我们的跟踪管理带来了一定影响; 三是目前的份额净值计算精度 (基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位, 小数点后第 4 位四舍五入) 所带来的跟踪误差, 这也是本期跟踪误差的主要来源之一。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济增速下降得到市场确认后, 虽然央行在二季度启动降息, 但带有一点利率市场化的意味, 存贷款利率实际波动的不对称结果, 导致“降息”对于股市的短期效用较以往有所折扣, 但从长远来看, 有利于市场的资源优化。从近大半年来的政策基调和措施观察来看, 所谓的经济刺激政策不太可能再次形成市场的拐点主因, 以转型为主线、以微调为短期手段将成为常态, 其整体力度从短期来看要低于资本市场投资者普遍习惯的“救市”预期程度, 这将造成投资者预期的波动, 在反复确认经济层面没有明显转机后, 自然加剧悲观的反馈。另外, 我们也看到, 海外市场仍然存在波动风险, 无论结局如何, 经济和货币本身都会受到影响。

目前是经济寻底的过程, 有几个方面值得关注, 首先, 通过对近期经济数据的分析我们可以发现, 虽然 PMI 数据整体不尽如人意, 但从分项可以看到, 国内需求有所回升, 这也在一定程度上稳定了制造业景气波动, 其次, 展望后期, 市场资金面有望进一步改善, 假如后期货币政策有助于进一步降低市场真实利率的话, 这将很大程度上缓解目前的企业经营及盈利状况, 有助于经济的逐步回暖。除市场整体方向外, 把握经济及产业政策方面作出的结构性的调整及方向将是投资者获取超额收益的主要来源之一。

同时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。

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 截止本报告期末, 本基金可供分配利润为-364, 477, 751.28元, 期末基金份额净值0.728元, 不符合利润分配条件, 本基金本期将不进行利润分配。

4.7.2 本基金本报告期内未进行利润分配。

§ 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

2012年上半年, 本基金托管人在对鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定, 不存在任何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

2012年上半年, 鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)的管理人——鹏华基金管理有限公司在鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回

价格计算、基金费用开支等问题上, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内, 鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 未进行利润分配。

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

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2012 年上半年年度报告中财务指标、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进行了核查, 以上内容真实、准确和完整。

§ 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 500 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2012 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	50,699,835.19	45,460,873.02
结算备付金		593,230.47	596,351.51
存出保证金		364,777.11	642,023.90
交易性金融资产	6.4.7.2	922,980,741.40	851,541,181.53
其中: 股票投资		922,980,741.40	851,541,181.53
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
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		5,038,749.84	3,018,362.37
应收利息	6.4.7.5	9,648.24	9,676.48
应收股利		98,838.86	-
应收申购款		862,874.89	683,709.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		980,648,696.00	901,952,177.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 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		3,659,956.98	4,625,901.44
应付赎回款		243,221.82	356,062.69
应付管理人报酬		624,646.90	618,041.49
应付托管费		124,929.39	123,608.30
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	834,761.28	757,436.24
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	289,585.65	161,324.94
负债合计		5,777,102.02	6,642,375.10
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,339,349,345.26	1,303,188,501.95
未分配利润	6.4.7.10	-364,477,751.28	-407,878,699.20
所有者权益合计		974,871,593.98	895,309,802.75
负债和所有者权益总计		980,648,696.00	901,952,177.85

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.728 元，基金份额总额 1,339,349,345.26 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		62,039,244.25	-82,118,213.64
1.利息收入		207,939.46	277,785.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	207,939.46	277,679.75
债券利息收入		-	105.89
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）		-65,443,725.18	25,483,890.49
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-70,830,941.03	20,995,273.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	33,998.11
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-

股利收益	6.4.7.15	5,387,215.85	4,454,618.70
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	126,952,695.52	-108,504,495.86
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	322,334.45	624,606.09
二、费用		6,844,115.31	8,049,342.26
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,887,645.32	4,784,531.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	777,529.05	956,906.27
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,845,673.68	1,951,727.53
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	333,267.26	356,176.87
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		55,195,128.94	-90,167,555.90
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		55,195,128.94	-90,167,555.90

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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)	1,303,188,501.95	-407,878,699.20	895,309,802.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	55,195,128.94	55,195,128.94
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)	36,160,843.31	-11,794,181.02	24,366,662.29
其中: 1. 基金申购款	486,642,441.81	-117,404,787.78	369,237,654.03
2. 基金赎回款	-450,481,598.50	105,610,606.76	-344,870,991.74
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)	1,339,349,345.26	-364,477,751.28	974,871,593.98
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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)	1,206,398,882.34	34,579,576.38	1,240,978,458.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-90,167,555.90	-90,167,555.90
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)	-74,747,459.25	5,353,410.90	-69,394,048.35
其中: 1. 基金申购款	550,941,294.07	13,803,523.81	564,744,817.88

2. 基金赎回款	-625,688,753.32	-8,450,112.91	-634,138,866.23
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)	1,131,651,423.09	-50,234,568.62	1,081,416,854.47

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：

<u> 邓召明 </u>	<u> 胡湘 </u>	<u> 刘慧红 </u>
基金管理公司负责人	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

鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF) (以下简称“本基金”), 系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[2009]1374 号文《关于核准鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》的核准, 由基金管理人鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的约定募集设立。本基金为上市契约型开放式, 存续期限为不定期, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,629,831,732.31 元, 经普华永道中天会计师事务所有限公司验证并出具普华永道中天验字(2010)第 021 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2010 年 2 月 5 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 2,630,723,634.12 份基金份额, 其中认购资金利息折合 891,901.81 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, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2010]第 129 号文审核同意, 本基金 583,423,342.00 份基金份额于 2010 年 4 月 28 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定, 本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 主要投资于中证 500 指数的成份股及其备选成份股(投资比例不低于基金资产净值的 90%), 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外, 为更好的实现投资目标, 本基金将少量投资于非中证 500 成份股、新股(首次发行或增发等)以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金业绩比较基准为: 中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 第 15 页 共 50 页

项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5号《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〉》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)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2012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2012年6月30日的财务状况以及2012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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本报告期本基金没有发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

本报告期税项未发生变化。

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 2012年6月30日
活期存款	50,699,835.19
定期存款	-
其中:存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计:	50,699,835.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,071,246,991.90	922,980,741.40	-148,266,250.50
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	1,071,246,991.90	922,980,741.40	-148,266,250.50	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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余额。

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

截止本报告期末, 本基金未持有买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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 2012年6月30日
应收活期存款利息	9,407.94
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	240.30
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	9,648.24

6.4.7.6 其他资产

截止本报告期末, 本基金未持有其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位: 人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	834,761.28
银行间市场应付交易费用	-
合计	834,761.28

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	772.39
预提费用	228,741.24
应付指数使用费	54,072.02
应付代垫券商席位年费	6,000.00
合计	289,585.65

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,303,188,501.95	1,303,188,501.95
本期申购	486,642,441.81	486,642,441.81
本期赎回(以“-”号填列)	-450,481,598.50	-450,481,598.50
本期末	1,339,349,345.26	1,339,349,345.26

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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	-59,446,166.12	-348,432,533.08	-407,878,699.20
本期利润	-71,757,566.58	126,952,695.52	55,195,128.94
本期基金份额交易产生的变动数	681,459.47	-12,475,640.49	-11,794,181.02
其中：基金申购款	-28,495,714.99	-88,909,072.79	-117,404,787.78
基金赎回款	29,177,174.46	76,433,432.30	105,610,606.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-130,522,273.23	-233,955,478.05	-364,477,751.28

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	195,181.22
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	9,278.89
其他	3,479.35

合计	207,939.46
----	------------

注：其他为申购款利息收入。

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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	603,125,136.25
减：卖出股票成本总额	673,956,077.28
买卖股票差价收入	-70,830,941.03

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内没有发生债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期没有发生衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,387,215.85
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,387,215.85

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	126,952,695.52
——股票投资	126,952,695.52
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	126,952,695.52

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	115,899.76
转换费收入	206,434.69
合计	322,334.45

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,845,673.68
银行间市场交易费用	-
合计	1,845,673.68

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,179.94
银行划付费	454.00
上市年费	29,835.26
指数使用费	104,072.02
合计	333,267.26

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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

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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	346,383,921.88	28.58%	70,652,722.12	5.61%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比较期间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

本基金本报告期内及上年度可比较期间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

本基金本报告期内及上年度可比较期间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 2012年1月1日至2012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	294,427.27	28.89%	202,026.03	24.20%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	60,055.19	5.73%	0.00	0.00%

注：(1) 佣金的计算公式

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

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

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

(2) 本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易单元租用协议》。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	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,887,645.32	4,784,531.59
其中：支付销售机构的客户维护费	676,646.56	945,422.41

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 0.75%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.75%÷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	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	777,529.05	956,906.27

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费年费率为 0.15%，逐日计提，按月支付。

日托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间管理人未投资、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

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	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 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
中国工商银行	50,699,835.19	195,181.22	56,195,358.25	253,417.83

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间没有参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末 (2012 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

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债券及权证等其他证券。

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
600499	科达机电	2012 年 6 月 20 日	重大事项停牌	10.28	2012 年 7 月 2 日	10.11	293,723	4,102,621.55	3,019,472.44	-
600780	通宝能源	2012 年 1 月 18 日	重大事项停牌	6.70	-	-	268,283	1,784,288.34	1,797,496.10	注
000767	*ST 漳电	2012 年 6 月 1 日	筹划资产重组	3.72	2012 年 7 月 27 日	3.90	406,352	1,637,774.86	1,511,629.44	-

注: 山西通宝能源股份有限公司 2011 年度利润分配方案为: 向全体股东每 10 股派发现金 1 元 (含税), 股权登记日为 2012 年 6 月 20 日, 除权除息日为 2011 年 6 月 21 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

截至本报告期末, 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同责任，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工商银行股份有限公司，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 2012 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2011 年 12 月 31 日：未持有）。

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、组合在短期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 2012 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	50,699,835.19	-	-	-	50,699,835.19
结算备付金	593,230.47	-	-	-	593,230.47
存出保证金	-	-	-	364,777.11	364,777.11
交易性金融资产	-	-	-	922,980,741.40	922,980,741.40
应收证券清算款	-	-	-	5,038,749.84	5,038,749.84
应收利息	-	-	-	9,648.24	9,648.24
应收股利	-	-	-	98,838.86	98,838.86
应收申购款	-	-	-	862,874.89	862,874.89
资产总计	51,293,065.66	-	-	929,355,630.34	980,648,696.00
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,659,956.98	3,659,956.98
应付赎回款	-	-	-	243,221.82	243,221.82
应付管理人报酬	-	-	-	624,646.90	624,646.90
应付托管费	-	-	-	124,929.39	124,929.39
应付交易费用	-	-	-	834,761.28	834,761.28
其他负债	-	-	-	289,585.65	289,585.65
负债总计	-	-	-	5,777,102.02	5,777,102.02
利率敏感度缺口	51,293,065.66	-	-	923,578,528.32	974,871,593.98
上年度末 2011 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	45,460,873.02	-	-	-	45,460,873.02
结算备付金	596,351.51	-	-	-	596,351.51
存出保证金	-	-	-	642,023.90	642,023.90
交易性金融资产	-	-	-	851,541,181.53	851,541,181.53
应收证券清算款	-	-	-	3,018,362.37	3,018,362.37
应收利息	-	-	-	9,676.48	9,676.48
应收申购款	-	-	-	683,709.04	683,709.04
资产总计	46,057,224.53	-	-	855,894,953.32	901,952,177.85
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,625,901.44	4,625,901.44
应付赎回款	-	-	-	356,062.69	356,062.69
应付管理人报酬	-	-	-	618,041.49	618,041.49
应付托管费	-	-	-	123,608.30	123,608.30
应付交易费用	-	-	-	757,436.24	757,436.24
其他负债	-	-	-	161,324.94	161,324.94
负债总计	-	-	-	6,642,375.10	6,642,375.10
利率敏感度缺口	46,057,224.53	-	-	849,252,578.22	895,309,802.75

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约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

于 2012 年 6 月 30 日, 本基金未持有的交易性债券投资 (2011 年 12 月 31 日: 未持有), 因此当利率发生合理、可能的变动时, 对于本基金资产净值无重大影响 (2011 年 12 月 31 日: 同)。

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。

本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股, 其投资比例不低于基金资产净值的 90%。

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 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 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	922,980,741.40	94.68	851,541,181.53	95.11
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—

其他	-	-	-	-
合计	922,980,741.40	94.68	851,541,181.53	95.11

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 (2012 年 6 月 30 日)	上年度末 (2011 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	48,529,969.22	44,637,017.76
业绩比较基准下降 5%	-48,529,969.22	-44,637,017.76	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值, 公允价值层级可分为:

第一层级: 相同资产或负债在活跃市场上 (未经调整) 的报价。

第二层级: 直接 (比如取自价格) 或间接 (比如根据价格推算的) 可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级: 以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值 (不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 6 月 30 日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 916,652,143.42 元, 属于第二层级的余额为 6,328,597.98 元, 无属于第三层级的余额 (2011 年 12 月 31 日: 第一层级 825,065,950.57 元, 第二层级 26,475,230.96 元, 无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃 (包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，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	922,980,741.40	94.12
	其中：股票	922,980,741.40	94.12
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	51,293,065.66	5.23
6	其他各项资产	6,374,888.94	0.65
7	合计	980,648,696.00	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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	15,762,349.27	1.62
B	采掘业	15,507,414.32	1.59
C	制造业	525,031,975.88	53.86
C0	食品、饮料	59,553,890.87	6.11
C1	纺织、服装、皮毛	27,260,715.09	2.80
C2	木材、家具	3,422,689.20	0.35
C3	造纸、印刷	15,052,995.48	1.54
C4	石油、化学、塑胶、塑料	86,857,887.63	8.91
C5	电子	56,372,411.11	5.78
C6	金属、非金属	52,433,639.21	5.38
C7	机械、设备、仪表	135,642,357.23	13.91
C8	医药、生物制品	76,925,667.84	7.89
C99	其他制造业	11,509,722.22	1.18
D	电力、煤气及水的生产和供应业	40,090,341.06	4.11
E	建筑业	16,754,828.24	1.72

F	交通运输、仓储业	37,579,524.04	3.85
G	信息技术业	50,164,787.08	5.15
H	批发和零售贸易	50,260,023.63	5.16
I	金融、保险业	12,483,957.75	1.28
J	房地产业	71,924,916.65	7.38
K	社会服务业	33,251,715.07	3.41
L	传播与文化产业	27,223,186.73	2.79
M	综合类	26,945,721.68	2.76
	合计	922,980,741.40	94.68

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	000799	酒鬼酒	113,670	5,956,308.00	0.61
2	600199	金种子酒	227,233	5,676,280.34	0.58
3	600079	人福医药	229,526	5,322,707.94	0.55
4	600702	沱牌舍得	137,313	4,977,596.25	0.51
5	000917	电广传媒	195,863	4,843,691.99	0.50
6	600300	维维股份	484,237	4,590,566.76	0.47
7	600366	宁波韵升	209,577	4,350,818.52	0.45
8	600138	中青旅	241,853	4,348,516.94	0.45
9	600637	百视通	325,318	4,261,665.80	0.44
10	002029	七匹狼	146,710	4,078,538.00	0.42
11	000826	桑德环境	174,608	3,998,523.20	0.41
12	600570	恒生电子	291,373	3,997,637.56	0.41
13	600478	科力远	143,666	3,975,238.22	0.41
14	000750	国海证券	313,993	3,887,233.34	0.40
15	000522	白云山A	190,737	3,879,590.58	0.40
16	000963	华东医药	126,512	3,820,662.40	0.39
17	000939	凯迪电力	449,875	3,814,940.00	0.39
18	600157	永泰能源	412,951	3,749,595.08	0.38
19	600340	华夏幸福	206,000	3,726,540.00	0.38
20	600436	片仔癀	42,292	3,717,043.88	0.38
21	600643	爱建股份	445,007	3,671,307.75	0.38
22	002250	联化科技	210,921	3,638,387.25	0.37

23	002152	广电运通	218,200	3,600,300.00	0.37
24	600635	大众公用	768,800	3,582,608.00	0.37
25	002051	中工国际	133,792	3,553,515.52	0.36
26	002230	科大讯飞	176,602	3,479,059.40	0.36
27	000877	天山股份	356,618	3,477,025.50	0.36
28	000998	隆平高科	194,290	3,464,190.70	0.36
29	600141	兴发集团	164,895	3,411,677.55	0.35
30	600200	江苏吴中	364,400	3,337,904.00	0.34
31	000540	中天城投	446,478	3,295,007.64	0.34
32	000793	华闻传媒	530,792	3,280,294.56	0.34
33	000539	粤电力 A	495,574	3,270,788.40	0.34
34	002065	东华软件	147,324	3,270,592.80	0.34
35	600325	华发股份	380,032	3,237,872.64	0.33
36	600601	方正科技	1,274,967	3,200,167.17	0.33
37	000690	宝新能源	723,034	3,174,119.26	0.33
38	600059	古越龙山	221,512	3,160,976.24	0.32
39	600008	首创股份	642,600	3,142,314.00	0.32
40	600332	广州药业	136,722	3,133,668.24	0.32
41	000926	福星股份	331,612	3,097,256.08	0.32
42	600311	荣华实业	386,864	3,094,912.00	0.32
43	600805	悦达投资	330,065	3,079,506.45	0.32
44	600816	安信信托	184,813	3,071,592.06	0.32
45	600717	天津港	485,116	3,065,933.12	0.31
46	600499	科达机电	293,723	3,019,472.44	0.31
47	600158	中体产业	392,461	3,010,175.87	0.31
48	600879	航天电子	379,100	2,987,308.00	0.31
49	600072	中船股份	167,175	2,969,028.00	0.30
50	600675	中华企业	631,708	2,956,393.44	0.30
51	600750	江中药业	105,281	2,938,392.71	0.30
52	600594	益佰制药	146,733	2,905,313.40	0.30
53	002477	雏鹰农牧	153,725	2,897,716.25	0.30
54	600747	大连控股	616,996	2,881,371.32	0.30
55	600426	华鲁恒升	389,886	2,881,257.54	0.30
56	002450	康得新	181,000	2,879,710.00	0.30
57	600239	云南城投	334,888	2,843,199.12	0.29
58	000650	仁和药业	328,554	2,818,993.32	0.29
59	000762	西藏矿业	193,834	2,775,702.88	0.28
60	000400	许继电气	176,737	2,769,468.79	0.28
61	600522	中天科技	324,094	2,764,521.82	0.28

62	600636	三爱富	141,750	2,742,862.50	0.28
63	600210	紫江企业	665,096	2,740,195.52	0.28
64	000830	鲁西化工	599,070	2,719,777.80	0.28
65	002129	中环股份	211,543	2,718,327.55	0.28
66	600755	厦门国贸	543,280	2,716,400.00	0.28
67	000816	江淮动力	506,347	2,708,956.45	0.28
68	600312	平高电气	382,800	2,679,600.00	0.27
69	000518	四环生物	598,561	2,669,582.06	0.27
70	002008	大族激光	422,930	2,656,000.40	0.27
71	600820	隧道股份	298,215	2,654,113.50	0.27
72	000541	佛山照明	306,643	2,646,329.09	0.27
73	600458	时代新材	210,711	2,644,423.05	0.27
74	601588	北辰实业	927,354	2,642,958.90	0.27
75	002005	德豪润达	338,520	2,633,685.60	0.27
76	002063	远光软件	180,600	2,620,506.00	0.27
77	600787	中储股份	292,859	2,600,587.92	0.27
78	000683	远兴能源	460,219	2,600,237.35	0.27
79	600110	中科英华	669,188	2,596,449.44	0.27
80	600586	金晶科技	581,735	2,588,720.75	0.27
81	000550	江铃汽车	121,126	2,586,040.10	0.27
82	600572	康恩贝	240,157	2,552,868.91	0.26
83	600880	博瑞传播	255,758	2,549,907.26	0.26
84	600978	宜华木业	538,641	2,547,771.93	0.26
85	600616	金枫酒业	178,491	2,543,496.75	0.26
86	600269	赣粤高速	678,390	2,537,178.60	0.26
87	000616	亿城股份	692,782	2,535,582.12	0.26
88	600651	飞乐音响	358,014	2,527,578.84	0.26
89	600220	江苏阳光	828,545	2,510,491.35	0.26
90	000823	超声电子	179,397	2,502,588.15	0.26
91	600858	银座股份	212,097	2,498,502.66	0.26
92	600557	康缘药业	168,842	2,495,484.76	0.26
93	002022	科华生物	228,870	2,483,239.50	0.25
94	600517	置信电气	216,108	2,478,758.76	0.25
95	000735	罗牛山	511,770	2,471,849.10	0.25
96	600867	通化东宝	317,156	2,470,645.24	0.25
97	600388	龙净环保	99,726	2,467,221.24	0.25
98	600653	申华控股	1,014,778	2,465,910.54	0.25
99	600844	丹化科技	196,969	2,464,082.19	0.25
100	000860	顺鑫农业	153,187	2,454,055.74	0.25

101	000028	国药一致	81,673	2,432,221.94	0.25
102	000503	海虹控股	418,081	2,429,050.61	0.25
103	600112	长征电气	207,575	2,422,400.25	0.25
104	600064	南京高科	210,374	2,419,301.00	0.25
105	600351	亚宝药业	367,963	2,395,439.13	0.25
106	000031	中粮地产	527,002	2,392,589.08	0.25
107	600584	长电科技	498,400	2,392,320.00	0.25
108	600122	宏图高科	526,635	2,390,922.90	0.25
109	600704	物产中大	267,996	2,387,844.36	0.24
110	600425	青松建化	201,379	2,382,313.57	0.24
111	600872	中炬高新	463,087	2,371,005.44	0.24
112	600521	华海药业	156,753	2,368,537.83	0.24
113	002311	海大集团	132,570	2,367,700.20	0.24
114	600298	安琪酵母	96,048	2,363,741.28	0.24
115	002154	报喜鸟	173,265	2,361,601.95	0.24
116	000652	泰达股份	600,169	2,346,660.79	0.24
117	600511	国药股份	167,208	2,340,912.00	0.24
118	000900	现代投资	162,605	2,315,495.20	0.24
119	000636	风华高科	312,265	2,310,761.00	0.24
120	600720	祁连山	220,698	2,310,708.06	0.24
121	601002	晋亿实业	214,944	2,299,900.80	0.24
122	000006	深振业 A	400,342	2,285,952.82	0.23
123	000417	合肥百货	181,592	2,278,979.60	0.23
124	600597	光明乳业	244,186	2,275,813.52	0.23
125	000612	焦作万方	195,622	2,271,171.42	0.23
126	000415	渤海租赁	296,600	2,266,024.00	0.23
127	002123	荣信股份	199,118	2,263,971.66	0.23
128	000488	晨鸣纸业	517,612	2,261,964.44	0.23
129	000667	名流置业	1,045,758	2,258,837.28	0.23
130	000850	华茂股份	329,649	2,241,613.20	0.23
131	000848	承德露露	127,708	2,241,275.40	0.23
132	000759	中百集团	301,225	2,241,114.00	0.23
133	600326	西藏天路	223,187	2,227,406.26	0.23
134	002506	超日太阳	184,673	2,219,769.46	0.23
135	600067	冠城大通	395,678	2,203,926.46	0.23
136	000501	鄂武商 A	147,997	2,202,195.36	0.23
137	600575	芜湖港	283,181	2,191,820.94	0.22
138	000598	兴蓉投资	268,461	2,187,957.15	0.22
139	000930	中粮生化	448,532	2,179,865.52	0.22

140	000786	北新建材	167,471	2,167,074.74	0.22
141	600410	华胜天成	264,041	2,165,136.20	0.22
142	000829	天音控股	331,800	2,163,336.00	0.22
143	000897	津滨发展	751,727	2,149,939.22	0.22
144	600815	厦工股份	232,099	2,146,915.75	0.22
145	600161	天坛生物	150,400	2,146,208.00	0.22
146	000988	华工科技	155,260	2,137,930.20	0.22
147	002408	齐翔腾达	130,956	2,129,344.56	0.22
148	000571	新大洲 A	428,328	2,128,790.16	0.22
149	600525	长园集团	300,978	2,124,904.68	0.22
150	000601	韶能股份	554,024	2,116,371.68	0.22
151	000975	科学城	254,763	2,114,532.90	0.22
152	000997	新大陆	208,179	2,113,016.85	0.22
153	600765	中航重机	272,598	2,101,730.58	0.22
154	002482	广田股份	119,653	2,087,944.85	0.21
155	600236	桂冠电力	527,141	2,087,478.36	0.21
156	600736	苏州高新	368,789	2,087,345.74	0.21
157	000078	海王生物	303,643	2,086,027.41	0.21
158	600439	瑞贝卡	383,424	2,078,158.08	0.21
159	002011	盾安环境	194,981	2,076,547.65	0.21
160	002237	恒邦股份	53,171	2,072,605.58	0.21
161	002097	山河智能	238,329	2,068,695.72	0.21
162	002294	信立泰	76,199	2,057,373.00	0.21
163	000962	东方钨业	153,980	2,057,172.80	0.21
164	002168	深圳惠程	221,100	2,051,808.00	0.21
165	600021	上海电力	373,029	2,051,659.50	0.21
166	000627	天茂集团	629,542	2,046,011.50	0.21
167	600835	上海机电	234,356	2,045,927.88	0.21
168	000426	兴业矿业	153,153	2,044,592.55	0.21
169	001696	宗申动力	344,989	2,042,334.88	0.21
170	000511	银基发展	537,164	2,041,223.20	0.21
171	000685	中山公用	139,822	2,040,002.98	0.21
172	000927	一汽夏利	277,653	2,035,196.49	0.21
173	000659	珠海中富	600,816	2,030,758.08	0.21
174	600428	中远航运	493,800	2,009,766.00	0.21
175	600993	马应龙	116,228	2,004,933.00	0.21
176	600491	龙元建设	330,670	2,003,860.20	0.21
177	002140	东华科技	104,036	2,002,693.00	0.21
178	600740	山西焦化	231,200	1,995,256.00	0.20

179	000973	佛塑科技	428,955	1,994,640.75	0.20
180	600176	中国玻纤	202,825	1,993,769.75	0.20
181	600884	杉杉股份	167,382	1,990,171.98	0.20
182	600069	银鸽投资	335,855	1,981,544.50	0.20
183	600654	飞乐股份	438,675	1,978,424.25	0.20
184	600017	日照港	715,752	1,975,475.52	0.20
185	002161	远望谷	255,144	1,974,814.56	0.20
186	600759	正和股份	356,358	1,974,223.32	0.20
187	600596	新安股份	317,460	1,965,077.40	0.20
188	600724	宁波富达	252,216	1,962,240.48	0.20
189	600251	冠农股份	104,671	1,960,487.83	0.20
190	000655	金岭矿业	173,711	1,950,774.53	0.20
191	600240	华业地产	217,108	1,949,629.84	0.20
192	600195	中牧股份	113,623	1,938,408.38	0.20
193	600851	海欣股份	343,615	1,927,680.15	0.20
194	002233	塔牌集团	208,270	1,924,414.80	0.20
195	600330	天通股份	273,616	1,923,520.48	0.20
196	600531	豫光金铅	103,424	1,921,617.92	0.20
197	002277	友阿股份	122,033	1,904,935.13	0.20
198	002056	横店东磁	119,595	1,903,952.40	0.20
199	600611	大众交通	361,749	1,895,564.76	0.19
200	600078	澄星股份	231,110	1,892,790.90	0.19
201	002475	立讯精密	63,965	1,890,165.75	0.19
202	600685	广船国际	127,849	1,885,772.75	0.19
203	000682	东方电子	568,700	1,882,397.00	0.19
204	000572	海马汽车	576,552	1,879,559.52	0.19
205	600033	福建高速	795,658	1,877,752.88	0.19
206	600409	三友化工	287,035	1,874,338.55	0.19
207	002429	兆驰股份	165,502	1,870,172.60	0.19
208	600790	轻纺城	283,784	1,855,947.36	0.19
209	000563	陕国投 A	135,020	1,853,824.60	0.19
210	600496	精工钢构	238,775	1,850,506.25	0.19
211	000088	盐田港	451,710	1,842,976.80	0.19
212	600831	广电网络	229,081	1,839,520.43	0.19
213	600171	上海贝岭	313,496	1,837,086.56	0.19
214	600503	华丽家族	399,233	1,836,471.80	0.19
215	600322	天房发展	514,136	1,835,465.52	0.19
216	002293	罗莱家纺	24,600	1,835,160.00	0.19
217	002223	鱼跃医疗	123,410	1,832,638.50	0.19

218	002236	大华股份	59,605	1,829,873.50	0.19
219	000726	鲁泰 A	252,529	1,828,309.96	0.19
220	000861	海印股份	114,882	1,826,623.80	0.19
221	600004	白云机场	268,057	1,825,468.17	0.19
222	600509	天富热电	229,266	1,815,786.72	0.19
223	600197	伊力特	130,651	1,814,742.39	0.19
224	600545	新疆城建	315,507	1,811,010.18	0.19
225	600761	安徽合力	209,800	1,808,476.00	0.19
226	002048	宁波华翔	257,077	1,802,109.77	0.18
227	600198	大唐电信	178,920	1,801,724.40	0.18
228	002254	泰和新材	159,581	1,801,669.49	0.18
229	000510	金路集团	355,836	1,800,530.16	0.18
230	600780	通宝能源	268,283	1,797,496.10	0.18
231	000513	丽珠集团	64,229	1,784,923.91	0.18
232	002340	格林美	134,082	1,784,631.42	0.18
233	600261	阳光照明	149,835	1,783,036.50	0.18
234	600801	华新水泥	141,835	1,775,774.20	0.18
235	600139	西部资源	192,454	1,768,652.26	0.18
236	600380	健康元	361,200	1,766,268.00	0.18
237	601880	大连港	586,543	1,753,763.57	0.18
238	600797	浙大网新	371,623	1,750,344.33	0.18
239	600737	中粮屯河	293,600	1,749,856.00	0.18
240	002410	广联达	70,842	1,738,462.68	0.18
241	000932	华菱钢铁	704,600	1,719,224.00	0.18
242	600063	皖维高新	612,530	1,708,958.70	0.18
243	002028	思源电气	154,067	1,708,603.03	0.18
244	002041	登海种业	82,045	1,705,715.55	0.17
245	600773	西藏城投	134,362	1,698,335.68	0.17
246	600435	北方导航	216,743	1,697,097.69	0.17
247	600308	华泰股份	475,210	1,696,499.70	0.17
248	600628	新世界	247,596	1,696,032.60	0.17
249	600284	浦东建设	231,209	1,683,201.52	0.17
250	000717	韶钢松山	682,710	1,672,639.50	0.17
251	002025	航天电器	114,489	1,665,814.95	0.17
252	600227	赤天化	442,699	1,660,121.25	0.17
253	002646	青青稞酒	52,400	1,659,508.00	0.17
254	600268	国电南自	185,405	1,655,666.65	0.17
255	600963	岳阳林纸	391,979	1,646,311.80	0.17
256	600387	海越股份	179,727	1,646,299.32	0.17

257	600416	湘电股份	247,884	1,645,949.76	0.17
258	600289	亿阳信通	268,488	1,643,146.56	0.17
259	600038	哈飞股份	98,441	1,642,980.29	0.17
260	000712	锦龙股份	124,412	1,637,261.92	0.17
261	002006	精功科技	153,669	1,635,038.16	0.17
262	600086	东方金钰	123,100	1,619,996.00	0.17
263	002470	金正大	122,309	1,619,371.16	0.17
264	600537	亿晶光电	113,400	1,610,280.00	0.17
265	600723	首商股份	191,242	1,606,432.80	0.16
266	600580	卧龙电气	319,740	1,601,897.40	0.16
267	600888	新疆众和	155,045	1,601,614.85	0.16
268	600482	风帆股份	187,418	1,598,675.54	0.16
269	600662	强生控股	368,355	1,598,660.70	0.16
270	600103	青山纸业	490,946	1,595,574.50	0.16
271	000886	海南高速	460,665	1,593,900.90	0.16
272	002428	云南锗业	76,018	1,591,056.74	0.16
273	600612	老凤祥	61,600	1,586,200.00	0.16
274	000852	江钻股份	93,323	1,581,824.85	0.16
275	600056	中国医药	71,504	1,569,512.80	0.16
276	000777	中核科技	74,392	1,561,488.08	0.16
277	600329	中新药业	125,965	1,560,706.35	0.16
278	600830	香溢融通	185,094	1,558,491.48	0.16
279	000099	中信海直	179,314	1,554,652.38	0.16
280	000159	国际实业	196,011	1,548,486.90	0.16
281	600292	九龙电力	116,660	1,546,911.60	0.16
282	000525	红太阳	118,034	1,546,245.40	0.16
283	002249	大洋电机	166,208	1,545,734.40	0.16
284	600449	宁夏建材	165,644	1,543,802.08	0.16
285	600106	重庆路桥	421,325	1,542,049.50	0.16
286	600995	文山电力	222,575	1,540,219.00	0.16
287	000931	中关村	272,389	1,538,997.85	0.16
288	600163	福建南纸	302,936	1,538,914.88	0.16
289	002181	粤传媒	161,695	1,528,017.75	0.16
290	600707	彩虹股份	257,061	1,521,801.12	0.16
291	600748	上实发展	251,867	1,513,720.67	0.16
292	000767	*ST 漳电	406,352	1,511,629.44	0.16
293	600961	株冶集团	153,445	1,509,898.80	0.15
294	600467	好当家	212,595	1,509,424.50	0.15
295	002479	富春环保	99,910	1,506,642.80	0.15

296	600533	栖霞建设	366,169	1,504,954.59	0.15
297	002292	奥飞动漫	71,727	1,501,963.38	0.15
298	600270	外运发展	210,742	1,500,483.04	0.15
299	000066	长城电脑	380,660	1,499,800.40	0.15
300	000822	山东海化	312,521	1,493,850.38	0.15
301	002332	仙琚制药	119,152	1,489,400.00	0.15
302	600408	安泰集团	409,558	1,486,695.54	0.15
303	000090	深天健	205,387	1,484,948.01	0.15
304	002191	劲嘉股份	149,359	1,481,641.28	0.15
305	601616	广电电气	326,800	1,480,404.00	0.15
306	600479	千金药业	124,337	1,479,610.30	0.15
307	000301	东方市场	495,897	1,477,773.06	0.15
308	000887	中鼎股份	173,679	1,474,534.71	0.15
309	600622	嘉宝集团	239,501	1,472,931.15	0.15
310	600578	京能热电	183,800	1,472,238.00	0.15
311	002083	孚日股份	327,626	1,471,040.74	0.15
312	600127	金健米业	316,979	1,470,782.56	0.15
313	002308	威创股份	149,302	1,470,624.70	0.15
314	000506	中润资源	178,114	1,469,440.50	0.15
315	600581	八一钢铁	222,813	1,468,337.67	0.15
316	000656	金科股份	135,200	1,453,400.00	0.15
317	600825	新华传媒	243,211	1,444,673.34	0.15
318	600373	中文传媒	100,463	1,442,648.68	0.15
319	600117	西宁特钢	258,490	1,442,374.20	0.15
320	600824	益民集团	297,957	1,442,111.88	0.15
321	000410	沈阳机床	190,249	1,440,184.93	0.15
322	600121	郑州煤电	182,840	1,433,465.60	0.15
323	600295	鄂尔多斯	142,753	1,407,544.58	0.14
324	600290	华仪电气	215,328	1,403,938.56	0.14
325	600589	广东榕泰	243,719	1,386,761.11	0.14
326	000987	广州友谊	104,825	1,385,786.50	0.14
327	600487	亨通光电	72,093	1,385,627.46	0.14
328	600874	创业环保	252,966	1,381,194.36	0.14
329	002424	贵州百灵	82,366	1,376,335.86	0.14
330	002309	中利科技	140,076	1,364,340.24	0.14
331	000755	山西三维	188,927	1,358,385.13	0.14
332	600866	星湖科技	256,179	1,357,748.70	0.14
333	600869	三普药业	57,770	1,354,706.50	0.14
334	600481	双良节能	189,200	1,354,672.00	0.14

335	002078	太阳纸业	233,722	1,348,575.94	0.14
336	600569	安阳钢铁	556,499	1,346,727.58	0.14
337	000698	沈阳化工	269,164	1,343,128.36	0.14
338	600510	黑牡丹	185,220	1,342,845.00	0.14
339	000608	阳光股份	261,163	1,339,766.19	0.14
340	600339	天利高新	235,200	1,338,288.00	0.14
341	002283	天润曲轴	163,400	1,334,978.00	0.14
342	600337	美克股份	221,671	1,330,026.00	0.14
343	000912	泸天化	170,779	1,326,952.83	0.14
344	600468	百利电气	105,843	1,324,095.93	0.14
345	600107	美尔雅	167,441	1,317,760.67	0.14
346	002465	海格通信	58,120	1,313,512.00	0.13
347	002242	九阳股份	177,832	1,308,843.52	0.13
348	000979	中弘股份	176,611	1,306,921.40	0.13
349	601000	唐山港	196,813	1,306,838.32	0.13
350	601107	四川成渝	376,984	1,304,364.64	0.13
351	002440	闰土股份	89,509	1,299,670.68	0.13
352	600246	万通地产	352,373	1,296,732.64	0.13
353	600602	仪电电子	306,714	1,294,333.08	0.13
354	600673	东阳光铝	144,099	1,289,686.05	0.13
355	002601	佰利联	16,452	1,284,901.20	0.13
356	002179	中航光电	93,607	1,284,288.04	0.13
357	000554	泰山石油	224,110	1,284,150.30	0.13
358	601010	文峰股份	86,352	1,284,054.24	0.13
359	002612	朗姿股份	35,000	1,274,000.00	0.13
360	600551	时代出版	118,200	1,271,832.00	0.13
361	000543	皖能电力	179,916	1,261,211.16	0.13
362	600438	通威股份	200,704	1,260,421.12	0.13
363	601519	大智慧	243,600	1,259,412.00	0.13
364	000713	丰乐种业	122,153	1,259,397.43	0.13
365	002393	力生制药	40,514	1,258,769.98	0.13
366	002342	巨力索具	167,625	1,257,187.50	0.13
367	002306	湘鄂情	116,532	1,252,719.00	0.13
368	600360	华微电子	316,034	1,245,173.96	0.13
369	600073	上海梅林	174,111	1,237,929.21	0.13
370	000959	首钢股份	434,000	1,236,900.00	0.13
371	000919	金陵药业	146,582	1,234,220.44	0.13
372	002121	科陆电子	139,024	1,231,752.64	0.13
373	601678	滨化股份	115,054	1,226,475.64	0.13

374	002648	卫星石化	70,000	1,225,700.00	0.13
375	600162	香江控股	223,205	1,220,931.35	0.13
376	600223	鲁商置业	232,981	1,220,820.44	0.13
377	601100	恒立油缸	110,400	1,214,400.00	0.12
378	600429	三元股份	205,942	1,212,998.38	0.12
379	000708	大冶特钢	131,059	1,195,258.08	0.12
380	000951	中国重汽	97,801	1,187,304.14	0.12
381	600480	凌云股份	147,923	1,183,384.00	0.12
382	600864	哈投股份	190,460	1,180,852.00	0.12
383	600618	氯碱化工	131,127	1,180,143.00	0.12
384	600590	泰豪科技	172,764	1,179,978.12	0.12
385	600829	三精制药	101,517	1,179,627.54	0.12
386	000903	云内动力	277,081	1,177,594.25	0.12
387	600657	信达地产	265,706	1,177,077.58	0.12
388	000936	华西股份	260,932	1,176,803.32	0.12
389	002183	怡亚通	191,953	1,176,671.89	0.12
390	601886	江河幕墙	65,400	1,176,546.00	0.12
391	600507	方大特钢	302,193	1,175,530.77	0.12
392	000428	华天酒店	250,988	1,174,623.84	0.12
393	600501	航天晨光	136,272	1,166,488.32	0.12
394	600789	鲁抗医药	236,663	1,164,381.96	0.12
395	600226	升华拜克	165,162	1,162,740.48	0.12
396	002064	华峰氨纶	215,564	1,161,889.96	0.12
397	600469	风神股份	131,136	1,159,242.24	0.12
398	002252	上海莱士	85,747	1,158,441.97	0.12
399	600776	东方通信	222,334	1,156,136.80	0.12
400	600288	大恒科技	183,213	1,150,577.64	0.12
401	601801	皖新传媒	105,809	1,146,969.56	0.12
402	600676	交运股份	250,221	1,141,007.76	0.12
403	600644	乐山电力	133,208	1,133,600.08	0.12
404	600151	航天机电	175,000	1,132,250.00	0.12
405	601777	力帆股份	165,686	1,131,635.38	0.12
406	600633	浙报传媒	75,200	1,122,736.00	0.12
407	600710	常林股份	185,843	1,122,491.72	0.12
408	600475	华光股份	89,722	1,121,525.00	0.12
409	600639	浦东金桥	156,639	1,110,570.51	0.11
410	600460	士兰微	249,944	1,104,752.48	0.11
411	000837	秦川发展	159,967	1,100,572.96	0.11
412	000738	中航动控	109,785	1,097,850.00	0.11

413	600088	中视传媒	96,614	1,095,602.76	0.11
414	600054	黄山旅游	73,341	1,094,981.13	0.11
415	000418	小天鹅 A	128,675	1,092,450.75	0.11
416	002091	江苏国泰	105,123	1,092,227.97	0.11
417	000050	深天马 A	167,208	1,091,868.24	0.11
418	600641	万业企业	234,263	1,091,665.58	0.11
419	002285	世联地产	73,604	1,089,339.20	0.11
420	600782	新钢股份	243,136	1,086,817.92	0.11
421	600231	凌钢股份	233,641	1,086,430.65	0.11
422	600075	新疆天业	153,204	1,086,216.36	0.11
423	600810	神马股份	128,891	1,073,662.03	0.11
424	600488	天药股份	188,542	1,053,949.78	0.11
425	002267	陕天然气	59,406	1,053,268.38	0.11
426	601011	宝泰隆	90,344	1,047,990.40	0.11
427	000042	深 长 城	55,767	1,044,515.91	0.11
428	601126	四方股份	71,260	1,042,533.80	0.11
429	002238	天威视讯	73,118	1,040,469.14	0.11
430	002449	国星光电	124,800	1,037,088.00	0.11
431	600293	三峡新材	140,378	1,033,182.08	0.11
432	002384	东山精密	89,654	1,022,055.60	0.10
433	600328	兰太实业	125,543	1,021,920.02	0.10
434	000533	万 家 乐	241,359	1,011,294.21	0.10
435	600683	京投银泰	215,510	1,008,586.80	0.10
436	000620	新华联	186,115	1,006,882.15	0.10
437	002480	新筑股份	97,974	1,006,192.98	0.10
438	600563	法拉电子	65,504	999,591.04	0.10
439	600983	合肥三洋	124,033	992,264.00	0.10
440	000911	南宁糖业	100,385	984,776.85	0.10
441	002345	潮宏基	41,904	971,753.76	0.10
442	002437	誉衡药业	48,976	969,724.80	0.10
443	002109	兴化股份	124,746	965,534.04	0.10
444	002218	拓日新能	114,382	963,096.44	0.10
445	002276	万马电缆	176,972	955,648.80	0.10
446	601636	旗滨集团	121,600	950,912.00	0.10
447	000631	顺发恒业	182,579	940,281.85	0.10
448	000158	常山股份	250,967	938,616.58	0.10
449	600333	长春燃气	134,804	935,539.76	0.10
450	000514	渝 开 发	179,225	915,839.75	0.09
451	600277	亿利能源	178,763	915,266.56	0.09

452	002190	成飞集成	60,400	915,060.00	0.09
453	000893	东凌粮油	64,733	912,087.97	0.09
454	601999	出版传媒	128,713	911,288.04	0.09
455	002585	双星新材	72,504	909,200.16	0.09
456	002463	沪电股份	203,600	908,056.00	0.09
457	002320	海峡股份	74,490	907,288.20	0.09
458	002461	珠江啤酒	79,092	893,739.60	0.09
459	002498	汉缆股份	83,600	888,668.00	0.09
460	600386	北巴传媒	117,222	888,542.76	0.09
461	600725	云维股份	179,086	884,684.84	0.09
462	002232	启明信息	118,825	881,681.50	0.09
463	002194	武汉凡谷	129,726	880,839.54	0.09
464	601311	骆驼股份	94,702	879,781.58	0.09
465	002489	浙江永强	84,451	874,912.36	0.09
466	600743	华远地产	220,720	874,051.20	0.09
467	002414	高德红外	52,526	874,032.64	0.09
468	600287	江苏舜天	127,260	869,185.80	0.09
469	000949	新乡化纤	289,643	866,032.57	0.09
470	600061	中纺投资	175,478	859,842.20	0.09
471	002386	天原集团	112,061	851,663.60	0.09
472	002534	杭锅股份	46,659	838,928.82	0.09
473	600178	东安动力	134,934	831,193.44	0.09
474	002281	光迅科技	36,794	824,185.60	0.08
475	000517	荣安地产	123,612	818,311.44	0.08
476	000935	四川双马	107,800	813,890.00	0.08
477	000918	嘉凯城	210,800	809,472.00	0.08
478	002204	大连重工	50,100	796,590.00	0.08
479	000594	国恒铁路	324,223	794,346.35	0.08
480	600523	贵航股份	84,273	791,323.47	0.08
481	601908	京运通	100,400	786,132.00	0.08
482	601208	东材科技	107,469	784,523.70	0.08
483	002075	沙钢股份	183,523	779,972.75	0.08
484	002444	巨星科技	88,529	771,087.59	0.08
485	000925	众合机电	87,862	767,913.88	0.08
486	000732	泰禾集团	118,584	764,866.80	0.08
487	002326	永太科技	55,988	762,556.56	0.08
488	002574	明牌珠宝	42,000	737,940.00	0.08
489	002315	焦点科技	20,534	711,503.10	0.07
490	002362	汉王科技	62,534	693,502.06	0.07

491	000597	东北制药	97,381	671,928.90	0.07
492	000617	石油济柴	67,185	663,115.95	0.07
493	600258	首旅股份	54,064	659,040.16	0.07
494	002225	濮耐股份	85,300	644,868.00	0.07
495	600184	光电股份	36,536	629,149.92	0.06
496	000029	深深房 A	155,880	582,991.20	0.06
497	002383	合众思壮	32,694	557,432.70	0.06
498	002110	三钢闽光	92,950	552,123.00	0.06
499	002653	海思科	18,600	537,540.00	0.06
500	600819	耀皮玻璃	63,374	422,070.84	0.04
501	600623	双钱股份	36,259	352,437.48	0.04
502	002651	利君股份	19,200	301,824.00	0.03
503	600648	外高桥	15,474	130,755.30	0.01
504	601566	九牧王	1	27.85	0.00
505	000989	九芝堂	1	16.20	0.00
506	600754	锦江股份	1	15.80	0.00
507	000996	中国中期	1	14.95	0.00
508	600420	现代制药	1	13.58	0.00
509	002430	杭氧股份	1	12.09	0.00
510	600529	山东药玻	1	9.46	0.00
511	600363	联创光电	1	7.04	0.00
512	600168	武汉控股	1	6.96	0.00
513	600291	西水股份	1	6.71	0.00
514	600686	金龙汽车	1	6.56	0.00
515	600423	柳化股份	1	6.35	0.00
516	000905	厦门港务	1	6.17	0.00
517	600278	东方创业	1	5.74	0.00
518	600202	哈空调	1	5.35	0.00
519	600966	博汇纸业	1	5.06	0.00
520	600667	太极实业	1	5.00	0.00
521	000910	大亚科技	1	4.91	0.00
522	002062	宏润建设	1	4.73	0.00
523	002172	澳洋科技	1	4.27	0.00
524	600126	杭钢股份	1	3.59	0.00
525	000751	*ST 锌业	1	3.29	0.00
526	600006	东风汽车	1	3.15	0.00
527	601003	柳钢股份	1	3.14	0.00
528	000875	吉电股份	1	2.96	0.00
529	600087	*ST 长油	1	1.64	0.00

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

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	000970	中科三环	23,595,717.68	2.64
2	600199	金种子酒	13,781,572.91	1.54
3	002236	大华股份	11,275,584.45	1.26
4	000826	桑德环境	9,786,522.40	1.09
5	600157	永泰能源	9,747,168.36	1.09
6	002250	联化科技	7,765,883.75	0.87
7	002154	报喜鸟	7,621,786.91	0.85
8	002410	广联达	7,047,684.77	0.79
9	600425	青松建化	5,666,305.75	0.63
10	600240	华业地产	5,395,910.17	0.60
11	000563	陕国投 A	5,024,411.84	0.56
12	000861	海印股份	4,979,338.07	0.56
13	002475	立讯精密	4,430,396.14	0.49
14	002006	精工科技	4,388,698.99	0.49
15	002161	远望谷	4,044,478.37	0.45
16	600022	山东钢铁	3,933,593.27	0.44
17	000750	国海证券	3,829,727.42	0.43
18	002005	德豪润达	3,733,338.97	0.42
19	600635	大众公用	3,602,352.60	0.40
20	600340	华夏幸福	3,596,125.22	0.40

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	000970	中科三环	33,033,149.80	3.69
2	002236	大华股份	14,721,078.10	1.64

3	600199	金种子酒	13,654,432.06	1.53
4	000826	桑德环境	9,820,044.74	1.10
5	600157	永泰能源	8,610,973.03	0.96
6	002154	报喜鸟	8,214,817.20	0.92
7	002250	联化科技	7,377,928.12	0.82
8	600827	友谊股份	7,364,991.13	0.82
9	600060	海信电器	7,289,764.60	0.81
10	002410	广联达	7,167,463.06	0.80
11	600240	华业地产	5,711,640.19	0.64
12	600022	山东钢铁	5,421,717.05	0.61
13	600425	青松建化	5,328,769.06	0.60
14	000861	海印股份	4,973,045.37	0.56
15	000563	陕国投 A	4,936,818.51	0.55
16	002475	立讯精密	4,452,538.80	0.50
17	002006	精功科技	4,234,552.64	0.47
18	002161	远望谷	4,073,673.77	0.46
19	601566	九牧王	3,599,773.05	0.40
20	600724	宁波富达	3,504,099.39	0.39

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	618,442,941.63
卖出股票收入（成交）总额	603,125,136.25

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

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名的前五名债券投资明细

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名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	364,777.11
2	应收证券清算款	5,038,749.84
3	应收股利	98,838.86
4	应收利息	9,648.24
5	应收申购款	862,874.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,374,888.94

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.6 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.9.7 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

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
32,307	41,456.94	404,309,280.32	30.19%	935,040,064.94	69.81%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	高桂英	1,950,260.00	2.67%
2	王延安	1,280,252.00	1.76%
3	薛晓京	1,005,030.00	1.38%
4	肖菊华	1,000,070.00	1.37%
5	钟莉莉	1,000,060.00	1.37%
5	张雪红	1,000,060.00	1.37%
6	冷利群	800,024.00	1.10%
7	邹娜	746,536.00	1.02%
8	谢琳琳	725,521.00	0.99%
9	王军	673,000.00	0.92%
10	王晓东	600,048.00	0.82%

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	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	656,416.38	0.0490%

注：（1）本公司高级管理人员、基金投资和研发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；
（3）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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年2月5日）基金份额总额	2,630,723,634.12
本报告期期初基金份额总额	1,303,188,501.95
本报告期基金总申购份额	486,642,441.81
减：本报告期基金总赎回份额	450,481,598.50
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,339,349,345.26

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 本基金管理人——鹏华基金管理有限公司本报告期内没有发生重大人事变动。

10.2.2 本基金托管人——中国工商银行股份有限公司的基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

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	
长江证券	1	616,639,944.94	50.87%	508,341.14	49.88%	-
国信证券	1	346,383,921.88	28.58%	294,427.27	28.89%	-
银河证券	1	249,136,016.78	20.55%	216,381.81	21.23%	-

注：交易单元选择的标准和程序

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

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；

- (4) 内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足基金运作高度保密的要求;
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要, 并能为本基金提供全面的信息服务;
- (6) 研究实力较强, 有固定的研究机构和专门的研究人员, 能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2) 选择交易单位的程序:

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位的对象。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。我在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, 向中国银河证券股份有限公司、长江证券股份有限公司及国信证券股份有限公司租用交易单元作为基金专用交易单元, 并从 2010 年 2 月开始陆续使用。本报告期内上述交易单元未发生变化。

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

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。

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 500 指数证券投资基金 (LOF) 2011 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 1 月 18 日
2	鹏华基金参与广州银行网上银行费率优惠公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 2 月 22 日
3	鹏华基金新增广州银行为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 2 月 22 日
4	鹏华中证 500 指数证券投资基金更新招募说明书摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 3 月 17 日
5	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资者谨防假冒我公司名义进行非法证券活动的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 3 月 23 日
6	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2011 年年度报告摘要	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 3 月 26 日
7	鹏华基金参与工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 3 月 31 日
8	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2012 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 4 月 24 日
9	鹏华基金参与邮储银行手机银行费率优惠公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 4 月 27 日
10	鹏华基金参与交通银行费率优惠公告	中国证券报、证券	2012 年 6 月 28 日

		时报、上海证券报	
11	鹏华基金参与中信银行费率优惠公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 6 月 28 日
12	关于鹏华旗下部分基金参与银河证券网上交易和柜台系统申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2012 年 6 月 29 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》;
- (二)《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》;
- (三)《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2012 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第 43 层鹏华基金管理有限公司。

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.cn>) 查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司,本公司已开通客户服务系统,咨询电话:4006788999。

鹏华基金管理有限公司
2012 年 8 月 29 日