

鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)2013 年半年度报告

2013 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：2013 年 8 月 27 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 2013 年 8 月 22 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 2013 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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告 (未经审计)	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	50
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.10 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	51

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	54
§11 备查文件目录.....	56
11.1 备查文件目录.....	56
11.2 存放地点.....	56
11.3 查阅方式.....	56

§ 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	1,061,880,138.68 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 \times 95% + 银行同业存款利率 \times 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 号深圳国际商会中心第 43 层	北京市西城区复兴门内大街 55 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
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 北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013 年 1 月 1 日 - 2013 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-23,246,036.44
本期利润	17,265,659.98
加权平均基金份额本期利润	0.0157
本期加权平均净值利润率	2.14%
本期基金份额净值增长率	-0.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-339,747,032.75

期末可供分配基金份额利润	-0.3199
期末基金资产净值	722,133,105.93
期末基金份额净值	0.680
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-32.00%

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

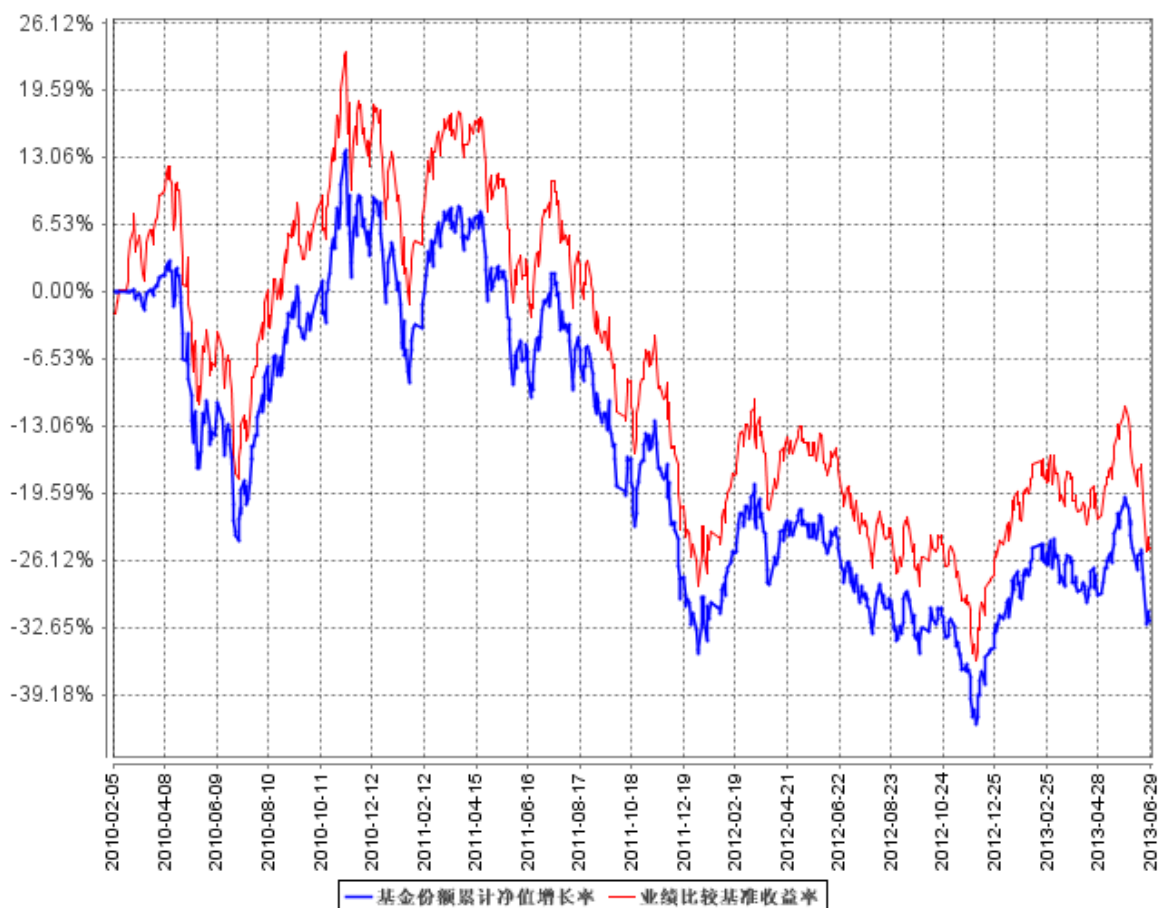
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-14.36%	1.85%	-15.01%	1.86%	0.65%	-0.01%
过去三个月	-5.29%	1.45%	-5.79%	1.46%	0.50%	-0.01%
过去六个月	-0.73%	1.42%	-1.08%	1.42%	0.35%	0.00%
过去一年	-6.59%	1.40%	-6.29%	1.40%	-0.30%	0.00%
过去三年	-12.60%	1.48%	-10.67%	1.49%	-1.93%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-32.00%	1.50%	-24.98%	1.53%	-7.02%	-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、37 只开放式基金和 7 只社保组合，经过近 15 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		
杨靖	本基金基金经理	2013 年 3 月 30 日	-	13	杨靖先生, 国籍中国, 管理学硕士, 13 年证券从业经验。曾在长城证券公司从事证券研究工作, 先后任研究员、行业研究小组组长; 2001 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作, 2005 年开始先后任鹏华中国 50 开放式证券投资基金、鹏华行业成长证券投资基金基金经理助理, 2006 年 8 月至 2007 年 4 月任原鹏华普润基金 (2007 年 4 月已转型为鹏华优质治理股票型证券投资基金 (LOF)) 基金经理, 2007 年 4 月至 2009 年 10 月担任鹏华优质治理股票型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2009 年 4 月起至今担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2012 年 9 月起至今兼任鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金基金经理, 2013 年 3 月起至今兼任鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。杨靖先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动, 改由杨靖担任本基金基金经理。
方南	本基金基金经理	2010 年 2 月 5 日	2013 年 3 月 30 日	11	方南先生, 国籍中国, 工商管理硕士, 11 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 2013 年 3 月担任鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2010

					年 8 月至 2013 年 3 月担任鹏华上证民企 50ETF 基金及其联接基金基金经理,2011 年 9 月至 2013 年 3 月担任鹏华深证民营 ETF 基金及其联接基金基金经理,2011 年 11 月至 2013 年 4 月担任量化投资部总经理助理。方南先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动,方南不再担任本基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易次数为 2 次,主要原因在于指数成份股交易不活跃导致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013 年上半年中证 500 指数震荡上行,最高达到 3884.68,一度接近两年内的高点;6 月份,受银行间市场流动性短缺乃至发展呈流动性恐慌的影响,指数大幅调整。今年以来,市场受宏观经济数据低于预期的影响,走势疲软,但场内资金在管理层转换经济增长方式的背景下,热捧传媒、TMT 等新兴产业,市场风格偏向中小市值股票,而中证 500 指数成份股中,中小市值个股占

比相对较高，因此上半年指数走势强于大盘。

年初以来指数走势波动较大，导致投资者频繁的申购赎回，给基金操作带来较大的压力。但经过精心操作，本基金的跟踪误差仍控制在较低的水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.68 元，累计净值 0.68 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.73%，同期中证 500 指数增长率为-1.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

自中央到地方政府的换届逐步完成后，新班子转换经济增长方式的决心显而易见。转换增长方式，意味着政府资源、市场资源在各领域的重新配置，在此过程中，新兴产业将获得较多的发展机会。

但调整经济结构也将伴随着去产能去杠杆的阵痛，尤其在货币环境整体上偏紧的情况下，市场估值的上升空间有天花板；从外部经济环境来看，美国经济趋势不错，美国退出量化宽松只是时间的问题，这将导致热钱从新兴市场流出；此外，即将启动的 IPO 也不可避免地分流资金。因此下半年总体来看，虽然相对传统产业，新兴行业仍然将受到市场更多的关注，但其上涨空间也不可避免地受到流动性的制约。

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-339, 747, 032. 75元, 期末基金份额净值 0. 680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

本报告期内, 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

本报告期内, 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) 2013年半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: 2013 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	39,108,611.95	109,192,615.75
结算备付金		4,167,975.77	2,499,887.73
存出保证金		361,706.95	364,873.07
交易性金融资产	6.4.7.2	681,301,121.39	779,738,411.37
其中: 股票投资		681,301,121.39	779,514,411.37
基金投资		-	-
债券投资		-	224,000.00
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		366,106.93	50,180,158.58
应收利息	6.4.7.5	8,462.86	9,522.66
应收股利		48,528.51	-
应收申购款		100,134.17	40,143,411.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		725,462,648.53	982,128,880.57
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 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		554,965.26	-
应付赎回款		199,060.33	157,853,640.17
应付管理人报酬		448,716.37	530,949.87
应付托管费		89,743.27	106,189.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,765,294.92	787,842.08
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	271,762.45	611,574.07
负债合计		3,329,542.60	159,890,196.16
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,061,880,138.68	1,200,228,393.59
未分配利润	6.4.7.10	-339,747,032.75	-377,989,709.18
所有者权益合计		722,133,105.93	822,238,684.41
负债和所有者权益总计		725,462,648.53	982,128,880.57

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.680 元，基金份额总额 1,061,880,138.68 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		24,064,826.26	62,039,244.25
1.利息收入		197,352.81	207,939.46
其中：存款利息收入	6.4.7.11	197,094.44	207,939.46
债券利息收入		258.37	-
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）		-17,393,785.63	-65,443,725.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-21,592,706.24	-70,830,941.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	41,572.88	-
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	4,157,347.73	5,387,215.85
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	40,511,696.42	126,952,695.52
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	749,562.66	322,334.45
减: 二、费用		6,799,166.28	6,844,115.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,000,619.96	3,887,645.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	600,123.96	777,529.05
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,876,853.34	1,845,673.68
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	321,569.02	333,267.26
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		17,265,659.98	55,195,128.94
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		17,265,659.98	55,195,128.94

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: 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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)	1,200,228,393.59	-377,989,709.18	822,238,684.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,265,659.98	17,265,659.98
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)	-138,348,254.91	20,977,016.45	-117,371,238.46
其中: 1. 基金申购款	750,196,375.87	-206,639,460.03	543,556,915.84
2. 基金赎回款	-888,544,630.78	227,616,476.48	-660,928,154.30
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)	1,061,880,138.68	-339,747,032.75	722,133,105.93
项目	上年度可比期间 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

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 _____ 毕国强 _____ 刘慧红
 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(特殊普通合伙)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 \times 95%+银行同业存款利率 \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 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 2013 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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。2013 年 1 月 1 日以前，对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。
- (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 2013 年 6 月 30 日
活期存款	39,108,611.95
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	39,108,611.95

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	738,235,855.87	681,301,121.39	-56,934,734.48

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		738,235,855.87	681,301,121.39	-56,934,734.48

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。

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。

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 2013年6月30日
应收活期存款利息	6,628.30
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	1,688.04
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	146.52
合计	8,462.86

注：其他为应收结算保证金利息。

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。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
----	-------------------

交易所市场应付交易费用	1,765,294.92
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,765,294.92

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	594.93
预提费用	221,167.52
指数使用费	50,000.00
合计	271,762.45

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,200,228,393.59	1,200,228,393.59
本期申购	750,196,375.87	750,196,375.87
本期赎回(以“-”号填列)	-888,544,630.78	-888,544,630.78
本期末	1,061,880,138.68	1,061,880,138.68

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	-218,973,284.48	-159,016,424.70	-377,989,709.18
本期利润	-23,246,036.44	40,511,696.42	17,265,659.98
本期基金份额交易产生的变动数	23,617,640.13	-2,640,623.68	20,977,016.45
其中：基金申购款	-151,986,505.57	-54,652,954.46	-206,639,460.03
基金赎回款	175,604,145.70	52,012,330.78	227,616,476.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-218,601,680.79	-121,145,351.96	-339,747,032.75

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	170,272.92
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	10,699.06
其他	16,122.46
合计	197,094.44

注：其他为结算保证金利息收入 14,029.70 元和申购款利息收入 2,092.76 元。

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	989,839,587.49
减：卖出股票成本总额	1,011,432,293.73
买卖股票差价收入	-21,592,706.24

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	265,863.16
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	224,000.00
减：应收利息总额	290.28
债券投资收益	41,572.88

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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,157,347.73
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,157,347.73

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	40,511,696.42
——股票投资	40,511,696.42
——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	40,511,696.42

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	395,581.64
转换费收入	353,981.02
合计	749,562.66

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,876,853.34
银行间市场交易费用	-
合计	2,876,853.34

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
审计费用	42,647.22
信息披露费	148,767.52
上市年费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
银行汇划费用	401.50
合计	321,569.02

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	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 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	25,368,399.48	1.37%	346,383,921.88	28.58%

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 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013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	23,095.54	1.39%	137,808.02	7.81%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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 2013年1月1日至2013年6 月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30 日
	当期发生的基金应支付 的管理费	3,000,619.96

其中: 支付销售机构的客户维护费	623, 635. 54	676, 646. 56
------------------	--------------	--------------

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
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	600, 123. 96	777, 529. 05

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

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		2012 年 1 月 1 日至 2012 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	39, 108, 611. 95	170, 272. 92	50, 699, 835. 19	195, 181. 22

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 (2013 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。

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
600436	片仔癀	2013年6月21日	配股停牌	136.82	2013年7月1日	118.73	33,957	3,366,610.01	4,645,996.74	-
000997	新大陆	2013年6月3日	资产重组	15.11	2013年8月23日	14.21	243,133	3,088,037.29	3,673,739.63	-
600983	合肥三洋	2013年5月14日	重大事项	9.96	2013年8月14日	10.90	300,890	2,663,935.96	2,996,864.40	-
600284	浦东建设	2013年6月24日	资产重组	9.50	-	-	312,464	2,953,948.49	2,968,408.00	-
601886	江河创建	2013年6月20日	重大事项	13.22	2013年7月16日	13.78	199,329	2,152,606.65	2,635,129.38	-
000683	远兴能源	2013年4月4日	资产重组	4.80	2013年7月18日	5.09	313,423	2,055,342.16	1,504,430.40	-
600292	九龙电力	2013年6月5日	资产重组	19.37	2013年7月1日	17.50	76,592	1,047,310.27	1,483,587.04	-
600654	飞乐股份	2013年4月4日	资产重组	4.63	2013年7月16日	5.09	308,858	1,580,987.64	1,430,012.54	-
002252	上海莱士	2013年3月26日	资产重组	21.00	2013年7月2日	22.80	60,341	876,494.34	1,267,161.00	-
600088	中视传媒	2013年5月30日	资产重组	14.29	-	-	74,015	907,041.97	1,057,674.35	-
600725	云维股份	2013年6月24日	资产重组	3.77	2013年7月1日	3.42	116,537	455,878.64	439,344.49	-
000719	大地传媒	2013年5月17日	资产重组	9.61	2013年8月12日	10.57	41,031	390,629.33	394,307.91	-
000998	隆平高科	2013年5月3日	资产重组	20.73	2013年7月8日	20.50	133,815	2,526,257.85	2,773,984.95	-

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 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2012 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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、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 2013 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	39,108,611.95	-	-	-	39,108,611.95
结算备付金	4,167,975.77	-	-	-	4,167,975.77
存出保证金	361,706.95	-	-	-	361,706.95
交易性金融资产	-	-	-	681,301,121.39	681,301,121.39
应收证券清算款	-	-	-	366,106.93	366,106.93
应收利息	-	-	-	8,462.86	8,462.86
应收股利	-	-	-	48,528.51	48,528.51
应收申购款	-	-	-	100,134.17	100,134.17
资产总计	43,638,294.67	-	-	681,824,353.86	725,462,648.53
负债					
应付证券清算款	-	-	-	554,965.26	554,965.26
应付赎回款	-	-	-	199,060.33	199,060.33
应付管理人报酬	-	-	-	448,716.37	448,716.37
应付托管费	-	-	-	89,743.27	89,743.27
应付交易费用	-	-	-	1,765,294.92	1,765,294.92
其他负债	-	-	-	271,762.45	271,762.45
负债总计	-	-	-	3,329,542.60	3,329,542.60
利率敏感度缺口	43,638,294.67	-	-	678,494,811.26	722,133,105.93
上年度末 2012 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	109,192,615.75	-	-	-	109,192,615.75
结算备付金	2,499,887.73	-	-	-	2,499,887.73
存出保证金	-	-	-	364,873.07	364,873.07
交易性金融资产	-	-	224,000.00	779,514,411.37	779,738,411.37
应收证券清算款	-	-	-	50,180,158.58	50,180,158.58
应收利息	-	-	-	9,522.66	9,522.66
应收申购款	-	-	-	40,143,411.41	40,143,411.41
资产总计	111,692,503.48	-	224,000.00	870,212,377.09	982,128,880.57
负债					

应付赎回款	-	-	-	157,853,640.17	157,853,640.17
应付管理人报酬	-	-	-	530,949.87	530,949.87
应付托管费	-	-	-	106,189.97	106,189.97
应付交易费用	-	-	-	787,842.08	787,842.08
其他负债	-	-	-	611,574.07	611,574.07
负债总计	-	-	-	159,890,196.16	159,890,196.16
利率敏感度缺口	111,692,503.48	-	224,000.00	710,322,180.93	822,238,684.41

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金为指数基金，主要投资于标的指数成份股、备选成份股，利率风险不是本基金的主要风险。于 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，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。

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 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 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	681,301,121.39	94.35	779,514,411.37	94.80
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	681,301,121.39	94.35	779,514,411.37	94.80

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 (2013 年 6 月 30 日)	上年度末 (2012 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	36,025,109.47	40,943,375.29
业绩比较基准下降 5%	-36,025,109.47	-40,943,375.29	

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

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。

以公允价值计量的金融工具

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)。

各层级金融工具公允价值

于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 654,030,480.56 元，属于第二层级的余额为 27,270,640.83 元，无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日：第一层级 758,029,152.66 元，第二层级 21,709,258.71 元，无第三层级)。

公允价值所属层级间的重大变动

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，本基金不会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还是第三层级。

第三层级公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2012 年 12 月 31 日：同)。本基金本期净转入/(转出)第三层级的金额为零元，计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为零元(2012 年度：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	681,301,121.39	93.91
	其中：股票	681,301,121.39	93.91
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	43,276,587.72	5.97
6	其他各项资产	884,939.42	0.12

7	合计	725,462,648.53	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	9,803,069.56	1.36
B	采矿业	11,020,926.40	1.53
C	制造业	409,719,916.40	56.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	36,884,881.42	5.11
E	建筑业	22,286,351.54	3.09
F	批发和零售业	32,634,439.32	4.52
G	交通运输、仓储和邮政业	14,971,028.18	2.07
H	住宿和餐饮业	140,208.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,166,027.79	5.15
J	金融业	7,283,159.98	1.01
K	房地产业	63,646,031.24	8.81
L	租赁和商务服务业	8,882,245.15	1.23
M	科学研究和技术服务业	2,520,234.31	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	9,264,949.42	1.28
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	12,678,960.12	1.76
S	综合	2,398,692.56	0.33
	合计	681,301,121.39	94.35

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	002230	科大讯飞	162,402	7,502,972.40	1.04

2	002450	康得新	217,532	6,086,545.36	0.84
3	000661	长春高新	57,562	5,635,895.42	0.78
4	000826	桑德环境	172,638	5,571,028.26	0.77
5	600867	通化东宝	362,892	5,403,461.88	0.75
6	002456	欧菲光	105,984	5,051,197.44	0.70
7	600594	益佰制药	153,905	4,757,203.55	0.66
8	600436	片仔癀	33,957	4,645,996.74	0.64
9	600557	康缘药业	165,284	4,388,290.20	0.61
10	000400	许继电气	151,294	4,097,041.52	0.57
11	600521	华海药业	266,913	4,070,423.25	0.56
12	600422	昆明制药	148,254	3,928,731.00	0.54
13	000503	海虹控股	276,308	3,890,416.64	0.54
14	000848	承德露露	162,566	3,691,873.86	0.51
15	000997	新大陆	243,133	3,673,739.63	0.51
16	600312	平高电气	397,512	3,665,060.64	0.51
17	600872	中炬高新	520,401	3,658,419.03	0.51
18	600517	置信电气	258,801	3,649,094.10	0.51
19	000690	宝新能源	778,163	3,634,021.21	0.50
20	600079	人福医药	136,526	3,560,598.08	0.49
21	600110	中科英华	713,836	3,547,764.92	0.49
22	600596	新安股份	329,142	3,472,448.10	0.48
23	600584	长电科技	596,373	3,470,890.86	0.48
24	002004	华邦颖泰	243,315	3,428,308.35	0.47
25	600601	方正科技	1,461,452	3,361,339.60	0.47
26	000598	兴蓉投资	689,470	3,316,350.70	0.46
27	600200	江苏吴中	211,628	3,309,861.92	0.46
28	002219	独一味	171,922	3,292,306.30	0.46
29	600851	海欣股份	450,963	3,278,501.01	0.45
30	002294	信立泰	113,001	3,270,248.94	0.45
31	000793	华闻传媒	321,041	3,216,830.82	0.45
32	000917	电广传媒	273,292	3,216,646.84	0.45
33	600086	东方金钰	157,465	3,191,815.55	0.44
34	600643	爱建股份	500,960	3,171,076.80	0.44
35	002008	大族激光	281,221	3,146,862.99	0.44
36	600597	光明乳业	231,880	3,128,061.20	0.43
37	002482	广田股份	146,745	3,081,645.00	0.43
38	600199	金种子酒	227,601	3,074,889.51	0.43
39	002028	思源电气	190,664	2,999,144.72	0.42
40	600983	合肥三洋	300,890	2,996,864.40	0.42

41	600388	龙净环保	131,665	2,984,845.55	0.41
42	000028	国药一致	106,528	2,974,261.76	0.41
43	600284	浦东建设	312,464	2,968,408.00	0.41
44	000566	海南海药	288,464	2,922,140.32	0.40
45	603000	人民网	65,964	2,896,479.24	0.40
46	600978	宜华木业	659,202	2,893,896.78	0.40
47	002065	东华软件	143,222	2,835,795.60	0.39
48	002250	联化科技	141,287	2,824,327.13	0.39
49	002161	远望谷	365,352	2,783,982.24	0.39
50	000998	隆平高科	133,815	2,773,984.95	0.38
51	600790	轻纺城	455,178	2,749,275.12	0.38
52	600161	天坛生物	193,454	2,729,635.94	0.38
53	002428	云南锗业	240,490	2,722,346.80	0.38
54	600008	首创股份	422,573	2,696,015.74	0.37
55	002437	誉衡药业	105,291	2,692,290.87	0.37
56	600578	京能热电	382,275	2,649,165.75	0.37
57	002480	新筑股份	170,204	2,638,162.00	0.37
58	601886	江河创建	199,329	2,635,129.38	0.36
59	002475	立讯精密	125,433	2,634,093.00	0.36
60	600773	西藏城投	242,399	2,615,485.21	0.36
61	600426	华鲁恒升	475,862	2,602,965.14	0.36
62	000563	陕国投 A	164,437	2,589,882.75	0.36
63	000415	渤海租赁	417,722	2,585,699.18	0.36
64	002041	登海种业	121,440	2,578,171.20	0.36
65	000601	韶能股份	779,584	2,564,831.36	0.36
66	600509	天富热电	299,183	2,555,022.82	0.35
67	002064	华峰氨纶	365,733	2,538,187.02	0.35
68	002244	滨江集团	302,088	2,537,539.20	0.35
69	000652	泰达股份	773,006	2,527,729.62	0.35
70	600858	银座股份	321,564	2,524,277.40	0.35
71	600645	中源协和	100,049	2,520,234.31	0.35
72	000078	海王生物	405,206	2,512,277.20	0.35
73	002573	国电清新	153,611	2,500,787.08	0.35
74	002129	中环股份	135,286	2,494,673.84	0.35
75	600311	荣华实业	499,825	2,489,128.50	0.34
76	600879	航天电子	368,458	2,472,353.18	0.34
77	002470	金正大	174,903	2,462,634.24	0.34
78	002237	恒邦股份	179,568	2,449,307.52	0.34
79	600880	博瑞传播	138,729	2,445,792.27	0.34

80	000816	江淮动力	677,388	2,445,370.68	0.34
81	600418	江淮汽车	347,073	2,439,923.19	0.34
82	600141	兴发集团	216,982	2,430,198.40	0.34
83	600765	中航重机	179,560	2,413,286.40	0.33
84	000612	焦作万方	283,967	2,405,200.49	0.33
85	000636	风华高科	449,710	2,401,451.40	0.33
86	600805	悦达投资	261,866	2,398,692.56	0.33
87	600759	正和股份	608,673	2,385,998.16	0.33
88	000860	顺鑫农业	218,985	2,382,556.80	0.33
89	600570	恒生电子	189,979	2,374,737.50	0.33
90	002663	普邦园林	156,086	2,352,216.02	0.33
91	002410	广联达	123,969	2,350,452.24	0.33
92	002305	南国置业	284,723	2,348,964.75	0.33
93	600545	新疆城建	481,300	2,319,866.00	0.32
94	002340	格林美	251,230	2,318,852.90	0.32
95	600380	健康元	552,499	2,298,395.84	0.32
96	600801	华新水泥	213,474	2,258,554.92	0.31
97	600333	长春燃气	277,968	2,251,540.80	0.31
98	002022	科华生物	151,574	2,244,810.94	0.31
99	600622	嘉宝集团	401,424	2,231,917.44	0.31
100	002285	世联地产	222,231	2,208,976.14	0.31
101	002408	齐翔腾达	192,905	2,208,762.25	0.31
102	600580	卧龙电气	408,912	2,208,124.80	0.31
103	600067	冠城大通	271,616	2,170,211.84	0.30
104	600078	澄星股份	367,888	2,166,860.32	0.30
105	600227	赤天化	776,030	2,157,363.40	0.30
106	600612	老凤祥	131,654	2,155,175.98	0.30
107	002479	富春环保	295,116	2,148,444.48	0.30
108	000732	泰禾集团	236,466	2,135,287.98	0.30
109	002190	成飞集成	173,054	2,132,025.28	0.30
110	600499	科达机电	179,170	2,130,331.30	0.30
111	600337	美克股份	395,324	2,126,843.12	0.29
112	600056	中国医药	129,137	2,116,555.43	0.29
113	600246	万通地产	679,026	2,111,770.86	0.29
114	000777	中核科技	139,651	2,100,351.04	0.29
115	600138	中青旅	159,911	2,090,036.77	0.29
116	000903	云内动力	496,960	2,087,232.00	0.29
117	002005	德豪润达	224,316	2,086,138.80	0.29
118	000543	皖能电力	357,900	2,075,820.00	0.29

119	000540	中天城投	294,584	2,065,033.84	0.29
120	000682	东方电子	812,644	2,055,989.32	0.28
121	002646	青青稞酒	101,545	2,055,270.80	0.28
122	000301	东方市场	753,435	2,049,343.20	0.28
123	601126	四方股份	141,486	2,044,472.70	0.28
124	600073	上海梅林	323,948	2,018,196.04	0.28
125	600162	香江控股	356,737	2,004,861.94	0.28
126	000935	四川双马	351,490	1,999,978.10	0.28
127	600117	西宁特钢	532,812	1,976,732.52	0.27
128	600198	大唐电信	152,353	1,974,494.88	0.27
129	600590	泰豪科技	357,643	1,970,612.93	0.27
130	600675	中华企业	418,262	1,949,100.92	0.27
131	000786	北新建材	110,457	1,946,252.34	0.27
132	600743	华远地产	739,226	1,944,164.38	0.27
133	600635	大众公用	506,506	1,934,852.92	0.27
134	002118	紫鑫药业	273,405	1,927,505.25	0.27
135	600184	光电股份	84,258	1,900,860.48	0.26
136	002152	广电运通	172,442	1,893,413.16	0.26
137	600641	万业企业	583,344	1,837,533.60	0.25
138	600522	中天科技	216,895	1,830,593.80	0.25
139	002063	远光软件	124,272	1,795,730.40	0.25
140	600366	宁波韵升	113,242	1,788,091.18	0.25
141	000506	中润资源	411,588	1,773,944.28	0.25
142	000735	罗牛山	338,716	1,768,097.52	0.24
143	600387	海越股份	118,889	1,740,534.96	0.24
144	000918	嘉凯城	630,293	1,727,002.82	0.24
145	600572	康恩贝	155,726	1,727,001.34	0.24
146	002140	东华科技	68,521	1,700,006.01	0.24
147	600435	北方导航	143,225	1,695,784.00	0.23
148	000762	西藏矿业	146,569	1,687,009.19	0.23
149	002386	天原集团	260,335	1,679,160.75	0.23
150	000517	荣安地产	352,160	1,672,760.00	0.23
151	600059	古越龙山	146,723	1,646,232.06	0.23
152	600717	天津港	322,048	1,616,680.96	0.22
153	002477	雏鹰农牧	101,080	1,596,053.20	0.22
154	002292	奥飞动漫	70,975	1,589,130.25	0.22
155	600511	国药股份	110,388	1,582,963.92	0.22
156	000926	福星股份	219,500	1,582,595.00	0.22
157	000513	丽珠集团	42,403	1,581,631.90	0.22

158	002653	海思科	55,298	1,575,993.00	0.22
159	600720	祁连山	183,441	1,566,586.14	0.22
160	000511	银基发展	355,057	1,551,599.09	0.21
161	002223	鱼跃医疗	81,843	1,542,740.55	0.21
162	600325	华发股份	251,690	1,530,275.20	0.21
163	600816	安信信托	122,069	1,522,200.43	0.21
164	000712	锦龙股份	86,106	1,514,604.54	0.21
165	000683	远兴能源	313,423	1,504,430.40	0.21
166	600820	隧道股份	199,856	1,488,927.20	0.21
167	600651	飞乐音响	283,827	1,487,253.48	0.21
168	600292	九龙电力	76,592	1,483,587.04	0.21
169	000726	鲁泰 A	174,031	1,468,821.64	0.20
170	600038	哈飞股份	64,808	1,452,995.36	0.20
171	600478	科力远	78,913	1,451,999.20	0.20
172	000830	鲁西化工	394,362	1,439,421.30	0.20
173	600654	飞乐股份	308,858	1,430,012.54	0.20
174	000939	凯迪电力	290,568	1,420,877.52	0.20
175	600240	华业地产	328,797	1,403,963.19	0.19
176	600151	航天机电	192,146	1,400,744.34	0.19
177	600797	浙大网新	258,561	1,378,130.13	0.19
178	600103	青山纸业	631,606	1,376,901.08	0.19
179	000877	天山股份	236,997	1,372,212.63	0.19
180	002048	宁波华翔	163,352	1,365,622.72	0.19
181	600064	南京高科	139,135	1,359,348.95	0.19
182	000975	银泰资源	167,157	1,357,314.84	0.19
183	600017	日照港	590,626	1,346,627.28	0.19
184	600702	沱牌舍得	90,815	1,334,072.35	0.18
185	600755	厦门国贸	358,407	1,333,274.04	0.18
186	002011	盾安环境	129,089	1,308,962.46	0.18
187	600351	亚宝药业	212,490	1,304,688.60	0.18
188	600373	中文传媒	76,092	1,297,368.60	0.18
189	000887	中鼎股份	205,880	1,297,044.00	0.18
190	000050	深天马 A	110,431	1,295,355.63	0.18
191	002168	深圳惠程	174,660	1,294,230.60	0.18
192	600458	时代新材	141,274	1,284,180.66	0.18
193	600158	中体产业	259,630	1,282,572.20	0.18
194	600750	江中药业	71,715	1,278,678.45	0.18
195	600874	创业环保	167,007	1,274,263.41	0.18
196	600586	金晶科技	382,359	1,269,431.88	0.18

197	002252	上海莱士	60,341	1,267,161.00	0.18
198	000518	四环生物	396,657	1,265,335.83	0.18
199	002325	洪涛股份	106,239	1,264,244.10	0.18
200	000572	海马汽车	380,105	1,261,948.60	0.17
201	600261	阳光照明	99,440	1,260,899.20	0.17
202	000541	佛山照明	202,968	1,256,371.92	0.17
203	600289	亿阳信通	177,675	1,254,385.50	0.17
204	000667	名流置业	695,700	1,238,346.00	0.17
205	600112	长征电气	136,888	1,237,467.52	0.17
206	600300	维维股份	289,627	1,230,914.75	0.17
207	002429	兆驰股份	163,875	1,227,423.75	0.17
208	600611	大众交通	240,026	1,226,532.86	0.17
209	600614	鼎立股份	85,806	1,226,167.74	0.17
210	600525	长园集团	199,007	1,225,883.12	0.17
211	000488	晨鸣纸业	342,862	1,224,017.34	0.17
212	000550	江铃汽车	79,861	1,222,671.91	0.17
213	002440	闰土股份	59,063	1,220,832.21	0.17
214	600993	马应龙	76,357	1,206,440.60	0.17
215	600220	江苏阳光	547,641	1,199,333.79	0.17
216	600884	杉杉股份	110,666	1,194,086.14	0.17
217	002308	威创股份	128,043	1,177,995.60	0.16
218	000525	红太阳	77,954	1,168,530.46	0.16
219	000680	山推股份	349,720	1,168,064.80	0.16
220	600239	云南城投	221,434	1,160,314.16	0.16
221	002465	海格通信	38,362	1,148,941.90	0.16
222	600787	中储股份	179,136	1,142,887.68	0.16
223	000616	亿城股份	398,989	1,137,118.65	0.16
224	000006	深振业 A	266,602	1,135,724.52	0.16
225	600236	桂冠电力	351,237	1,134,495.51	0.16
226	601002	晋亿实业	142,181	1,133,182.57	0.16
227	600004	白云机场	177,285	1,115,122.65	0.15
228	000685	中山公用	119,452	1,113,292.64	0.15
229	600210	紫江企业	397,286	1,112,400.80	0.15
230	600729	重庆百货	57,383	1,111,508.71	0.15
231	600864	哈投股份	125,870	1,105,138.60	0.15
232	600260	凯乐科技	162,457	1,104,707.60	0.15
233	002393	力生制药	35,050	1,096,364.00	0.15
234	000501	鄂武商 A	97,495	1,091,944.00	0.15
235	000417	合肥百货	210,096	1,088,297.28	0.15

236	600747	大连控股	299,254	1,083,299.48	0.15
237	600329	中新药业	83,142	1,074,194.64	0.15
238	001696	宗申动力	228,352	1,073,254.40	0.15
239	000897	津滨发展	498,220	1,071,173.00	0.15
240	600088	中视传媒	74,015	1,057,674.35	0.15
241	600183	生益科技	234,490	1,055,205.00	0.15
242	002309	中利科技	92,422	1,051,762.36	0.15
243	600835	上海机电	95,090	1,045,039.10	0.14
244	600409	三友化工	284,058	1,039,652.28	0.14
245	002029	七匹狼	145,130	1,037,679.50	0.14
246	000090	深天健	148,771	1,035,446.16	0.14
247	000627	天茂集团	415,250	1,029,820.00	0.14
248	600176	中国玻纤	134,513	1,026,334.19	0.14
249	000962	东方钽业	101,537	1,025,523.70	0.14
250	600636	三爱富	102,709	1,022,981.64	0.14
251	600021	上海电力	247,270	1,018,752.40	0.14
252	600831	广电网络	151,617	1,011,285.39	0.14
253	002648	卫星石化	46,027	1,011,213.19	0.14
254	000988	华工科技	174,813	1,003,426.62	0.14
255	600780	通宝能源	175,991	999,628.88	0.14
256	000088	盐田港	299,002	995,676.66	0.14
257	600633	浙报传媒	45,596	983,505.72	0.14
258	600428	中远航运	324,687	980,554.74	0.14
259	600748	上实发展	167,111	969,243.80	0.13
260	000886	海南高速	303,372	964,722.96	0.13
261	600251	冠农股份	69,732	963,696.24	0.13
262	002277	友阿股份	129,200	961,248.00	0.13
263	000931	中关村	207,366	958,030.92	0.13
264	002050	三花股份	78,088	952,673.60	0.13
265	000850	华茂股份	217,647	946,764.45	0.13
266	601311	骆驼股份	98,156	943,279.16	0.13
267	600500	中化国际	195,940	936,593.20	0.13
268	600460	士兰微	167,144	934,334.96	0.13
269	600757	长江传媒	159,564	931,853.76	0.13
270	600106	重庆路桥	278,969	920,597.70	0.13
271	002083	孚日股份	251,816	916,610.24	0.13
272	600482	风帆股份	124,059	915,555.42	0.13
273	600487	亨通光电	47,798	907,684.02	0.13
274	000959	首钢股份	457,408	901,093.76	0.12

275	600628	新世界	163,561	899,585.50	0.12
276	002216	三全食品	62,023	898,713.27	0.12
277	600269	赣粤高速	305,481	898,114.14	0.12
278	002091	江苏国泰	69,417	897,561.81	0.12
279	600326	西藏天路	147,335	894,323.45	0.12
280	600503	华丽家族	187,122	892,571.94	0.12
281	600481	双良节能	124,437	885,991.44	0.12
282	000031	中粮地产	239,450	873,992.50	0.12
283	601880	大连港	389,180	871,763.20	0.12
284	000510	金路集团	164,452	869,951.08	0.12
285	002254	泰和新材	136,956	868,301.04	0.12
286	600740	山西焦化	146,969	861,238.34	0.12
287	002179	中航光电	71,445	857,340.00	0.12
288	600330	天通股份	181,287	855,674.64	0.12
289	000426	兴业矿业	101,247	845,412.45	0.12
290	000655	金岭矿业	114,176	844,902.40	0.12
291	600479	千金药业	81,950	839,987.50	0.12
292	600308	华泰股份	313,152	839,247.36	0.12
293	600589	广东榕泰	162,324	839,215.08	0.12
294	600195	中牧股份	75,244	838,218.16	0.12
295	600410	华胜天成	137,775	837,672.00	0.12
296	002154	报喜鸟	138,319	836,829.95	0.12
297	600616	金枫酒业	118,176	836,686.08	0.12
298	600533	栖霞建设	241,950	834,727.50	0.12
299	600197	伊力特	84,726	832,009.32	0.12
300	000900	现代投资	108,335	830,929.45	0.12
301	002249	大洋电机	110,392	829,043.92	0.11
302	600844	丹化科技	111,755	823,634.35	0.11
303	600491	龙元建设	219,268	822,255.00	0.11
304	600298	安琪酵母	47,253	821,257.14	0.11
305	600830	香溢融通	122,528	818,487.04	0.11
306	600551	时代出版	77,941	812,145.22	0.11
307	002097	山河智能	142,171	803,266.15	0.11
308	002233	塔牌集团	137,683	801,315.06	0.11
309	600888	新疆众和	148,273	800,674.20	0.11
310	000979	中弘股份	117,083	792,651.91	0.11
311	600737	中粮屯河	157,451	790,404.02	0.11
312	600824	益民集团	177,371	787,527.24	0.11
313	600439	瑞贝卡	253,136	787,252.96	0.11

314	002025	航天电器	75,880	783,840.40	0.11
315	000930	中粮生化	198,606	782,507.64	0.11
316	600416	湘电股份	163,271	782,068.09	0.11
317	002424	贵州百灵	54,418	781,986.66	0.11
318	600072	中船股份	76,173	764,776.92	0.11
319	600139	西部资源	127,228	764,640.28	0.11
320	600704	物产中大	143,256	763,554.48	0.11
321	600408	安泰集团	271,692	763,454.52	0.11
322	000608	阳光股份	149,691	758,933.37	0.11
323	002444	巨星科技	58,455	755,823.15	0.10
324	000021	长城开发	169,626	754,835.70	0.10
325	002414	高德红外	34,683	752,621.10	0.10
326	000932	华菱钢铁	462,419	749,118.78	0.10
327	600488	天药股份	184,648	747,824.40	0.10
328	600449	宁夏建材	110,447	747,726.19	0.10
329	000759	中百集团	136,561	744,257.45	0.10
330	600122	宏图高科	223,885	738,820.50	0.10
331	000650	仁和药业	151,666	738,613.42	0.10
332	600467	好当家	140,608	738,192.00	0.10
333	000099	中信海直	118,198	736,373.54	0.10
334	601616	广电电气	215,122	735,717.24	0.10
335	601801	皖新传媒	69,755	726,149.55	0.10
336	600639	浦东金桥	101,192	721,498.96	0.10
337	000738	中航动控	72,332	714,640.16	0.10
338	600537	亿晶光电	74,981	710,819.88	0.10
339	601100	恒立油缸	72,750	708,585.00	0.10
340	002672	东江环保	19,712	697,016.32	0.10
341	000861	海印股份	75,816	696,749.04	0.10
342	603366	日出东方	45,966	695,005.92	0.10
343	600429	三元股份	135,772	693,794.92	0.10
344	600761	安徽合力	87,985	682,763.60	0.09
345	600995	文山电力	132,593	681,528.02	0.09
346	600496	精工钢构	99,815	680,738.30	0.09
347	600438	通威股份	132,669	680,591.97	0.09
348	600866	星湖科技	190,310	679,406.70	0.09
349	002093	国脉科技	132,966	660,841.02	0.09
350	000828	东莞控股	160,225	660,127.00	0.09
351	002430	杭氧股份	93,716	656,012.00	0.09
352	603001	奥康国际	46,386	652,651.02	0.09

353	600776	东方通信	146,726	651,463.44	0.09
354	600469	风神股份	86,315	647,362.50	0.09
355	600531	豫光金铅	68,137	643,213.28	0.09
356	000919	金陵药业	96,944	642,738.72	0.09
357	600673	东阳光铝	95,437	635,610.42	0.09
358	000822	山东海化	206,137	634,901.96	0.09
359	000533	万家乐	172,580	631,642.80	0.09
360	600295	鄂尔多斯	94,475	631,093.00	0.09
361	002449	国星光电	82,669	630,764.47	0.09
362	002342	巨力索具	110,245	627,294.05	0.09
363	601608	中信重工	189,692	624,086.68	0.09
364	600581	八一钢铁	147,692	623,260.24	0.09
365	002283	天润曲轴	128,976	620,374.56	0.09
366	600425	青松建化	163,098	619,772.40	0.09
367	000829	天音控股	110,090	612,100.40	0.08
368	002056	横店东磁	48,644	611,941.52	0.08
369	002345	潮宏基	55,525	609,109.25	0.08
370	600223	鲁商置业	154,069	605,491.17	0.08
371	000418	小天鹅 A	85,035	604,598.85	0.08
372	002123	荣信股份	87,010	602,979.30	0.08
373	600322	天房发展	200,111	602,334.11	0.08
374	600470	六国化工	102,823	601,514.55	0.08
375	000973	佛塑科技	173,324	599,701.04	0.08
376	002638	勤上光电	43,412	599,519.72	0.08
377	000823	超声电子	72,752	594,383.84	0.08
378	002078	太阳纸业	132,971	586,402.11	0.08
379	000620	新华联	123,053	582,040.69	0.08
380	600270	外运发展	86,858	581,948.60	0.08
381	000697	炼石有色	55,496	581,598.08	0.08
382	601777	力帆股份	109,353	576,290.31	0.08
383	002183	怡亚通	87,037	576,184.94	0.08
384	002194	武汉凡谷	85,298	569,790.64	0.08
385	600644	乐山电力	78,976	565,468.16	0.08
386	600075	新疆天业	91,205	559,998.70	0.08
387	600069	银鸽投资	131,236	556,440.64	0.08
388	600657	信达地产	176,008	547,384.88	0.08
389	000951	中国重汽	64,495	543,692.85	0.08
390	002238	天威视讯	49,477	529,403.90	0.07
391	600171	上海贝岭	119,235	519,864.60	0.07

392	601010	文峰股份	84,929	519,765.48	0.07
393	600094	大名城	100,939	517,817.07	0.07
394	002463	沪电股份	161,049	515,356.80	0.07
395	600618	氯碱化工	86,224	513,032.80	0.07
396	600815	厦工股份	132,046	512,338.48	0.07
397	601515	东风股份	42,981	511,473.90	0.07
398	600290	华仪电气	127,555	507,668.90	0.07
399	002332	仙琚制药	42,824	499,327.84	0.07
400	600054	黄山旅游	48,449	496,117.76	0.07
401	600826	兰生股份	44,766	495,559.62	0.07
402	000603	盛达矿业	38,648	493,921.44	0.07
403	600231	凌钢股份	155,082	490,059.12	0.07
404	000042	深 长 城	18,924	489,563.88	0.07
405	000554	泰山石油	133,313	485,259.32	0.07
406	002678	珠江钢琴	36,610	484,716.40	0.07
407	600710	常林股份	155,017	482,102.87	0.07
408	002489	浙江永强	55,118	481,731.32	0.07
409	600869	三普药业	75,920	475,259.20	0.07
410	002006	精功科技	67,427	469,291.92	0.06
411	002612	朗姿股份	22,988	468,035.68	0.06
412	000893	东凌粮油	37,104	467,510.40	0.06
413	600736	苏州高新	131,479	466,750.45	0.06
414	002225	濮耐股份	84,746	466,103.00	0.06
415	601999	出版传媒	85,176	463,357.44	0.06
416	600339	天利高新	140,397	463,310.10	0.06
417	002218	拓日新能	75,671	463,106.52	0.06
418	002181	粤 传 媒	53,159	462,483.30	0.06
419	002276	万马电缆	106,897	461,795.04	0.06
420	000912	泸 天 化	112,178	456,564.46	0.06
421	600226	升华拜克	98,342	450,406.36	0.06
422	601519	大智慧	122,735	449,210.10	0.06
423	601636	旗滨集团	80,120	440,660.00	0.06
424	601011	宝泰隆	59,917	440,389.95	0.06
425	600287	江苏舜天	75,667	439,625.27	0.06
426	600725	云维股份	116,537	439,344.49	0.06
427	601339	百隆东方	57,945	437,484.75	0.06
428	002498	汉缆股份	82,794	437,152.32	0.06
429	002574	明牌珠宝	36,708	432,787.32	0.06
430	002191	劲嘉股份	49,772	430,527.80	0.06

431	000852	江钻股份	33,064	429,832.00	0.06
432	000925	众合机电	54,058	429,220.52	0.06
433	600258	首旅股份	31,976	418,565.84	0.06
434	600063	皖维高新	210,632	412,838.72	0.06
435	600386	北巴传媒	69,999	411,594.12	0.06
436	002461	珠江啤酒	52,233	407,939.73	0.06
437	002320	海峡股份	49,404	407,583.00	0.06
438	600121	郑州煤电	73,256	399,245.20	0.06
439	600963	岳阳林纸	146,422	398,267.84	0.06
440	002396	星网锐捷	27,703	394,490.72	0.05
441	000719	大地传媒	41,031	394,307.91	0.05
442	600468	百利电气	34,266	388,919.10	0.05
443	600723	首商股份	61,606	386,885.68	0.05
444	000659	珠海中富	199,870	385,749.10	0.05
445	600662	强生控股	113,912	377,048.72	0.05
446	002267	陕天然气	36,052	370,254.04	0.05
447	600810	神马股份	76,085	365,968.85	0.05
448	000066	长城电脑	120,892	365,093.84	0.05
449	002392	北京利尔	61,899	363,347.13	0.05
450	600563	法拉电子	20,522	362,418.52	0.05
451	002226	江南化工	30,354	355,748.88	0.05
452	000410	沈阳机床	69,204	355,708.56	0.05
453	000911	南宁糖业	59,940	351,847.80	0.05
454	600825	新华传媒	70,276	349,974.48	0.05
455	000927	一汽夏利	94,271	339,375.60	0.05
456	600163	福建南纸	86,284	336,507.60	0.05
457	600268	国电南自	53,312	319,872.00	0.04
458	002384	东山精密	22,815	308,230.65	0.04
459	000159	国际实业	57,011	296,457.20	0.04
460	600683	京投银泰	62,107	296,250.39	0.04
461	002281	光迅科技	11,362	285,413.44	0.04
462	000698	沈阳化工	70,755	274,529.40	0.04
463	600501	航天晨光	39,339	271,439.10	0.04
464	000713	丰乐种业	32,513	264,330.69	0.04
465	002242	九阳股份	43,832	252,910.64	0.04
466	000987	广州友谊	25,697	220,223.29	0.03
467	601677	明泰铝业	31,010	220,171.00	0.03
468	002203	海亮股份	30,391	212,737.00	0.03
469	002121	科陆电子	30,551	206,524.76	0.03

470	002601	佰利联	13,134	199,899.48	0.03
471	600510	黑牡丹	42,162	199,426.26	0.03
472	603077	和邦股份	17,071	181,806.15	0.03
473	600480	凌云股份	27,267	174,781.47	0.02
474	601678	滨化股份	24,117	171,713.04	0.02
475	002293	罗莱家纺	10,169	170,229.06	0.02
476	000631	顺发恒业	38,136	169,705.20	0.02
477	600475	华光股份	17,793	162,983.88	0.02
478	600523	贵航股份	17,254	156,666.32	0.02
479	002506	*ST 超日	56,400	154,536.00	0.02
480	002306	湘鄂情	22,080	140,208.00	0.02
481	000936	华西股份	40,986	138,122.82	0.02
482	600397	安源煤业	30,417	136,876.50	0.02
483	601208	东材科技	24,065	135,245.30	0.02
484	000809	铁岭新城	15,036	127,956.36	0.02
485	600724	宁波富达	22,400	95,648.00	0.01
486	000671	阳光城	8,000	94,800.00	0.01
487	600841	上柴股份	6,600	91,542.00	0.01
488	600507	方大特钢	24,800	91,016.00	0.01
489	600850	华东电脑	4,000	90,600.00	0.01
490	600648	外高桥	6,400	89,536.00	0.01
491	601588	北辰实业	32,800	88,888.00	0.01
492	601929	吉视传媒	14,200	88,750.00	0.01
493	002503	搜于特	7,800	88,686.00	0.01
494	002075	沙钢股份	35,000	88,200.00	0.01
495	600006	东风汽车	31,800	88,086.00	0.01
496	600575	芜湖港	36,800	87,952.00	0.01
497	002317	众生药业	4,000	87,880.00	0.01
498	601000	唐山港	33,400	87,508.00	0.01
499	600026	中海发展	25,000	87,000.00	0.01
500	002049	同方国芯	3,200	86,848.00	0.01
501	002275	桂林三金	5,600	86,576.00	0.01
502	000982	中银绒业	10,800	86,508.00	0.01
503	600812	华北制药	19,200	86,400.00	0.01
504	002419	天虹商场	10,800	86,400.00	0.01
505	600595	中孚实业	24,400	86,132.00	0.01
506	601233	桐昆股份	17,000	86,020.00	0.01
507	000587	金叶珠宝	8,400	85,932.00	0.01
508	600180	瑞茂通	12,800	85,376.00	0.01

509	600490	中科合臣	9,400	85,352.00	0.01
510	002698	博实股份	4,800	85,200.00	0.01
511	002013	中航精机	7,200	85,176.00	0.01
512	600277	亿利能源	14,000	85,120.00	0.01
513	600039	四川路桥	16,400	85,116.00	0.01
514	002122	天马股份	23,800	84,966.00	0.01
515	002557	洽洽食品	5,000	84,950.00	0.01
516	002701	奥瑞金	3,000	84,600.00	0.01
517	002273	水晶光电	4,600	84,594.00	0.01
518	002262	恩华药业	3,800	84,550.00	0.01
519	600456	宝钛股份	7,200	84,456.00	0.01
520	002327	富安娜	6,600	84,348.00	0.01
521	002447	壹桥苗业	4,800	84,240.00	0.01
522	002167	东方锆业	8,600	84,194.00	0.01
523	603766	隆鑫通用	11,800	84,016.00	0.01
524	002287	奇正藏药	5,000	84,000.00	0.01
525	002490	山东墨龙	10,200	83,946.00	0.01
526	002073	软控股份	10,000	83,900.00	0.01
527	002405	四维图新	6,000	83,880.00	0.01
528	600770	综艺股份	14,200	83,780.00	0.01
529	600037	歌华有线	13,800	83,628.00	0.01
530	600401	海润光伏	14,400	83,520.00	0.01
531	000559	万向钱潮	15,800	82,950.00	0.01
532	000708	大冶特钢	15,362	82,033.08	0.01
533	002635	安洁科技	1,800	81,126.00	0.01
534	601216	内蒙君正	10,800	81,000.00	0.01
535	000755	山西三维	23,195	80,486.65	0.01
536	002204	大连重工	7,826	80,373.02	0.01
537	002232	启明信息	13,106	77,456.46	0.01
538	002662	京威股份	10,834	66,195.74	0.01
539	600829	三精制药	8,777	57,928.20	0.01
540	601388	怡球资源	6,540	56,701.80	0.01
541	601908	京运通	7,248	43,053.12	0.01
542	002534	杭锅股份	2,822	35,472.54	0.00
543	002585	双星新材	744	5,639.52	0.00
544	002651	利君股份	140	1,736.00	0.00
545	002315	焦点科技	1	34.80	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	002482	广田股份	9,698,287.91	1.18
2	002573	国电清新	7,930,765.78	0.96
3	002480	新筑股份	5,672,716.35	0.69
4	002230	科大讯飞	5,654,386.24	0.69
5	002663	普邦园林	5,498,486.57	0.67
6	000826	桑德环境	5,298,749.80	0.64
7	002004	华邦颖泰	5,107,270.95	0.62
8	600596	新安股份	5,097,859.89	0.62
9	002450	康得新	5,048,735.29	0.61
10	600643	爱建股份	4,996,168.85	0.61
11	600578	京能热电	4,956,159.87	0.60
12	600086	东方金钰	4,930,796.92	0.60
13	600311	荣华实业	4,862,824.34	0.59
14	600622	嘉宝集团	4,799,284.62	0.58
15	600978	宜华木业	4,796,395.55	0.58
16	002028	思源电气	4,736,271.46	0.58
17	600759	正和股份	4,703,218.74	0.57
18	600509	天富热电	4,668,327.46	0.57
19	000661	长春高新	4,654,302.99	0.57
20	600790	轻纺城	4,653,649.28	0.57

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	002482	广田股份	8,621,953.99	1.05

2	002573	国电清新	7,597,378.02	0.92
3	000826	桑德环境	6,864,509.47	0.83
4	000400	许继电气	5,960,324.47	0.72
5	002008	大族激光	5,927,004.39	0.72
6	000598	兴蓉投资	5,793,430.97	0.70
7	002450	康得新	5,787,941.77	0.70
8	600765	中航重机	5,773,061.16	0.70
9	600478	科力远	5,537,862.91	0.67
10	600805	悦达投资	5,383,850.54	0.65
11	002230	科大讯飞	5,291,194.35	0.64
12	000503	海虹控股	4,889,420.83	0.59
13	002429	兆驰股份	4,883,102.39	0.59
14	600418	江淮汽车	4,809,753.90	0.58
15	600079	人福医药	4,803,900.86	0.58
16	600332	广州药业	4,756,930.08	0.58
17	002653	海思科	4,696,166.00	0.57
18	002005	德豪润达	4,654,079.63	0.57
19	000661	长春高新	4,453,380.13	0.54
20	600596	新安股份	4,390,721.29	0.53

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	872,707,272.28
卖出股票收入（成交）总额	989,839,587.49

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

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。

7.10.2

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。

7.10.3 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	361,706.95
2	应收证券清算款	366,106.93
3	应收股利	48,528.51
4	应收利息	8,462.86
5	应收申购款	100,134.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	884,939.42

7.10.4 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。

7.10.5 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600436	片仔癀	4,645,996.74	0.64	配股停牌

7.10.6 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。

7.10.7 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
27,530	38,571.74	228,550,376.01	21.52%	833,329,762.67	78.48%

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	3.19%
2	王延安	1,280,252.00	2.09%
3	肖菊华	1,000,070.00	1.64%
4	张雪红	1,000,060.00	1.64%
	钟莉莉	1,000,060.00	1.64%
5	冷利群	800,024.00	1.31%
6	王军	673,000.00	1.10%
7	王晓东	600,048.00	0.98%
8	刘鑫萍	594,083.00	0.97%
9	韩可新	594,017.00	0.97%
10	朱建生	500,115.00	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
----	------------	----------

基金管理人所有从业人员持有本基金	691, 297. 87	0. 0651%
------------------	--------------	----------

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；
（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, 200, 228, 393. 59
本报告期基金总申购份额	750, 196, 375. 87
减：本报告期基金总赎回份额	888, 544, 630. 78
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, 061, 880, 138. 68

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：2013年3月，曹毅先生不再担任基金管理人副总裁职务。上述事项已经公司董事会审议通过。

10.2.2 基金托管人的重大人事变动：报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本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	
银河证券	1	938,614,615.38	50.68%	854,514.26	51.37%	-
长江证券	1	888,163,108.46	47.95%	785,898.69	47.24%	-
国信证券	1	25,368,399.48	1.37%	23,095.54	1.39%	-

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。本报告期内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

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
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	265,863.16	100.00%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

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旗下基金 2012 年 12 月 31 日资产净值公告	《中国证券报》，《上海证券报》，《证券时报》	2013 年 1 月 4 日
2	鹏华关于旗下基金参与诺亚正行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》	2013 年 1 月 4 日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与工商银行 2013 年定投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》	2013 年 1 月 4 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》，《上海证券报》，《证券时报》	2013 年 1 月 9 日
5	鹏华基金关于参加浙商银行费率优惠的公告	《中国证券报》，《上海证券报》，《证券时报》	2013 年 1 月 10 日
6	鹏华管理有限公司关于成立鹏华资产管理（深圳）有限公司的公告	《证券时报》	2013 年 1 月 12 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》，《上海证券报》，《证券时报》	2013 年 1 月 19 日

8	2012 年第 4 季报报告	《中国证券报》，《上海证券报》，《证券时报》	2013 年 1 月 22 日
9	关于旗下部分基金参加上海浦东发展银行股份有限公司电子渠道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》	2013 年 1 月 30 日
10	关于鹏华基金管理有限公司与财付通合作开通网上直销第三方支付业务的公告	《中国证券报》，《上海证券报》，《证券时报》	2013 年 2 月 1 日
11	关于鹏华基金管理有限公司与支付宝合作开通网上直销第三方支付业务及费率优惠的公告	《中国证券报》，《上海证券报》，《证券时报》	2013 年 2 月 1 日
12	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》，《上海证券报》，《证券时报》	2013 年 3 月 9 日
13	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》，《上海证券报》，《证券时报》	2013 年 3 月 16 日
14	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》，《上海证券报》，《证券时报》	2013 年 3 月 29 日
15	2012 年年度报告摘要	《中国证券报》，《上海证券报》，《证券时报》	2013 年 3 月 29 日
16	基金经理变更公告	《中国证券报》，《上海证券报》，《证券时报》	2013 年 3 月 30 日
17	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》，《上海证券报》，《证券时报》	2013 年 4 月 2 日
18	鹏华关于旗下基金参与和讯基金网上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》	2013 年 4 月 19 日
19	鹏华基金管理有限公司关于新增和讯信息科技有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	《中国证券报》，《上海证券报》，《证券时报》	2013 年 4 月 19 日
20	鹏华基金关于好买基金的上线定投的公告	《中国证券报》，《上海证券报》，《证券时报》	2013 年 4 月 19 日
21	鹏华关于部分基金参与好买基金网上定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》，《上海证券报》，《证券时报》	2013 年 4 月 19 日
22	2013 年第 1 季报报告	《中国证券报》，《上海证券报》，《证券时报》	2013 年 4 月 20 日

		报》	
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》	2013 年 6 月 21 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》	2013 年 6 月 25 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》	2013 年 6 月 25 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》	2013 年 6 月 27 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) 2013 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

北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行股份有限公司

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
2013 年 8 月 27 日