

# 鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)2014 年半年度报告

2014 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：2014 年 8 月 26 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 2014 年 8 月 21 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 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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.....	11
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
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
<b>§6 半年度财务会计报告 (未经审计)</b> .....	<b>13</b>
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
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>32</b>
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
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序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序的所有资产支持证券投资明细.....	49
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>51</b>

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.....	52
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	52
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>52</b>
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.....	53
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
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>56</b>
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)
场内简称	鹏华 500
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	692,726,730.95 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

### 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	<a href="http://www.phfund.com">http://www.phfund.com</a>
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 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(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	21,337,776.70
本期利润	12,768,963.28
加权平均基金份额本期利润	0.0165
本期加权平均净值利润率	2.05%
本期基金份额净值增长率	0.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	-135,802,666.72
期末可供分配基金份额利润	-0.1960
期末基金资产净值	556,924,064.23
期末基金份额净值	0.804
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2014年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	-19.60%

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

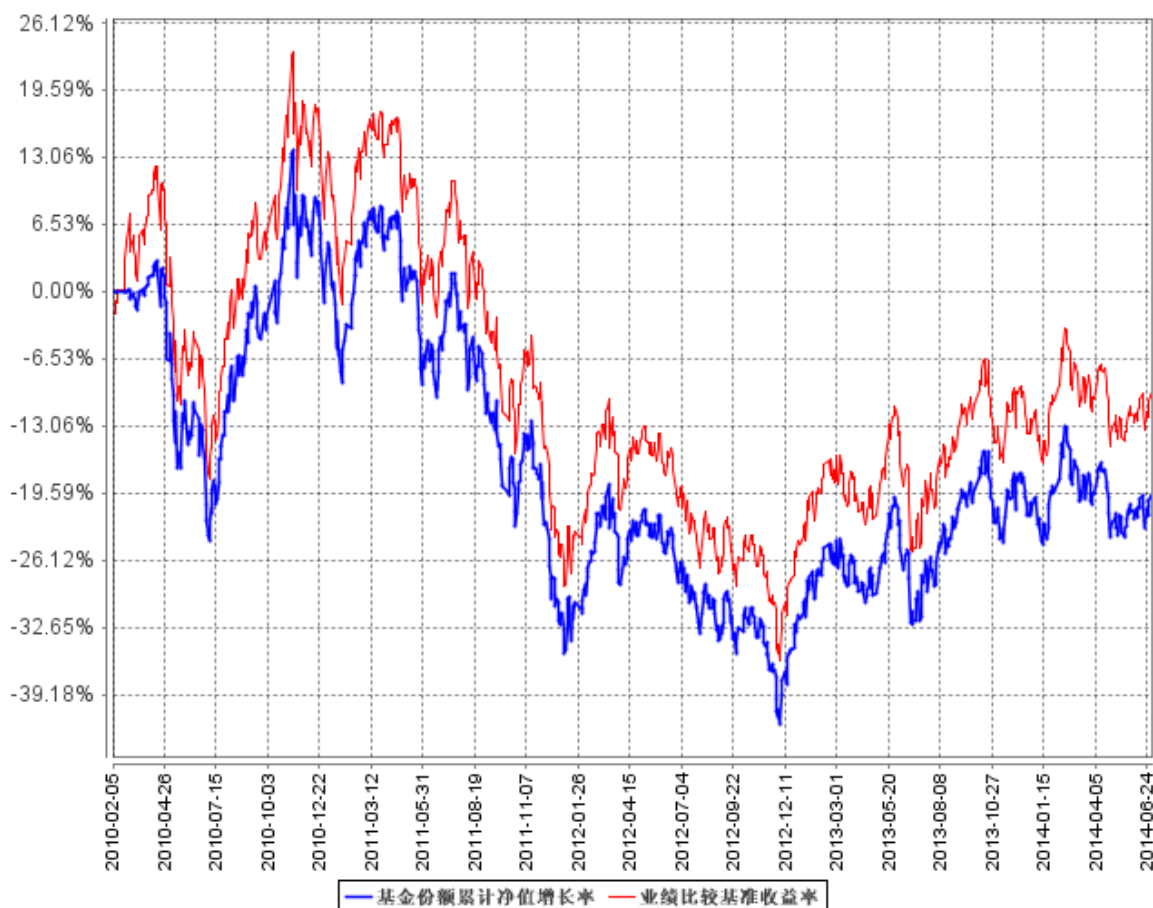
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.03%	0.93%	2.38%	0.93%	-0.35%	0.00%
过去三个月	1.39%	1.00%	2.11%	1.01%	-0.72%	-0.01%
过去六个月	0.75%	1.18%	2.44%	1.19%	-1.69%	-0.01%
过去一年	18.24%	1.25%	20.29%	1.26%	-2.05%	-0.01%
过去三年	-15.90%	1.40%	-13.21%	1.40%	-2.69%	0.00%
自基金合同生效起至今	-19.60%	1.45%	-9.76%	1.47%	-9.84%	-0.02%

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 51 只开放式基金和 7 只社保组合，经过近 16 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	-	14	杨靖先生, 国籍中国, 理学硕士, 14 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 9 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未发生变动。
王咏辉	本基金基金经理	2013 年 12 月 27 日	-	16	王咏辉先生, 英国牛津大学工程和计算机专业硕士, 16 年证券基金从业经验。曾担任伦敦摩根大通 (JP Morgan) 投资基金管理公司分析员、高级分析师, 汇丰投资基金管理公司 (HSBC) 高级分析师, 伦敦巴克莱国际投资基金管理公司基金经理、部门负责人, 巴克莱资本公司 (Barclays Capital) 部门负责人, 泰达宏利基金公司国际投资部副总监、产品与金融工程部副总经理等职, 2010 年 4 月至 2012 年 8 月担

				任泰达宏利中证财富大盘指数型证券投资基金基金经理，2011 年 7 月至 2012 年 8 月担任泰达宏利全球新格局证券投资 QDII 基金基金经理，2011 年 12 月至 2012 年 8 月担任泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金基金经理；2012 年 11 月加盟鹏华基金管理有限公司，现任量化投资部总经理、投资决策委员会成员，2013 年 12 月起担任鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。王咏辉先生具备基金从业资格，英国基金经理从业资格 (IMC)。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
--	--	--	--	---

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配各环节得到公平对待。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内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，主要原因分别在于采用量化策略的基金调仓和指数成分股交易不活跃导致。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年上半年, 中国经济在“稳增长”与“调结构”的背景下, 疲弱前行, A 股市场呈现窄幅震荡格局。本基金秉承指数基金的投资策略, 在报告期内连续遭遇较大比例申购赎回, 对基金净值造成一定影响, 管理人尽力降低影响, 在力争跟踪指数收益的基础上, 将基金跟踪误差控制在合理范围内。

### 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 0.8040 元, 累计净值 0.8040 元; 本报告期基金份额净值增长率为 0.75%, 同期中证 500 指数增长率为 2.44%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济仍然处于“再平衡”的过程中, 以转型为方向, 通过有序的改革释放增长新动力, 定向“稳增长”来防范系统性风险的爆发。近期受出口以及基建回升的支持, 经济有短期企稳迹象, 但房地产市场的调整仍在继续, 内需恢复乏力, 经济走出底部仍需时日。

近期公布的美国各项数据表现依然积极, 经济延续了恢复趋势。但随着美国经济的稳定复苏, QE 退出以及联储加息预期将升温, 从而导致全球资本流动逆转, 美元指数走强, 此外部风险值得关注。

在经济“再平衡”的背景下, A 股市场延续“弱平衡市”。经济转型驱动 A 股市值结构转型, 内部分化加剧。

我们继续保持前期的观点: 汇率和利率市场化将推动各类资产的宽幅震荡, 建议投资者从中长期投资的角度来配置资产, 重点关注成长性好的上市公司, 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, 力争为投资者带来超越指数收益的投资回报。

## 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]40号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定,本公司成立停牌股票、债券不活跃市场报价等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、债券研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

#### 4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度:

基金经理不参与或决定基金日常估值。

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

4.6.3 本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 本公司现没有进行任何定价服务的签约。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

4.7.1 截止本报告期末,本基金可供分配利润为-135,802,666.72元,期末基金份额净值0.804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) 2014 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: 2014 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	30,370,681.69	32,451,836.75
结算备付金		1,463,493.57	3,317.92
存出保证金		249,830.58	226,993.72
交易性金融资产	6.4.7.2	528,286,700.78	577,821,387.58
其中: 股票投资		528,286,700.78	577,821,387.58
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		971,902.19	1,919,946.80
应收利息	6.4.7.5	7,184.26	6,525.15
应收股利		-	-
应收申购款		29,757.47	100,721.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		561,379,550.54	612,530,729.90
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2013 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	2,224,790.98
应付赎回款		2,966,799.89	596,208.71
应付管理人报酬		339,765.05	399,781.16
应付托管费		67,953.01	79,956.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	802,916.27	609,120.22
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	278,052.09	342,294.05
负债合计		4,455,486.31	4,252,151.34
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	692,726,730.95	761,808,825.91
未分配利润	6.4.7.10	-135,802,666.72	-153,530,247.35
所有者权益合计		556,924,064.23	608,278,578.56
负债和所有者权益总计		561,379,550.54	612,530,729.90

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.804 元，基金份额总额 692,726,730.95 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 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
		2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		19,008,236.01	24,064,826.26
1.利息收入		159,579.32	197,352.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	159,398.02	197,094.44
债券利息收入		181.30	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）		27,084,636.24	-17,393,785.63
其中：股票投资收益	6.4.7.12	22,976,701.38	-21,592,706.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	9,736.15	41,572.88
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	4,098,198.71	4,157,347.73
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-8,568,813.42	40,511,696.42
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	332,833.87	749,562.66
<b>减: 二、费用</b>		6,239,272.73	6,799,166.28
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,333,803.54	3,000,619.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	466,760.68	600,123.96
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	3,116,724.99	2,876,853.34
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	321,983.52	321,569.02
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		12,768,963.28	17,265,659.98
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		12,768,963.28	17,265,659.98

### 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: 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 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)	761,808,825.91	-153,530,247.35	608,278,578.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,768,963.28	12,768,963.28
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)	-69,082,094.96	4,958,617.35	-64,123,477.61
其中: 1. 基金申购款	312,601,842.42	-64,164,729.87	248,437,112.55
2. 基金赎回款	-381,683,937.38	69,123,347.22	-312,560,590.16
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)	692,726,730.95	-135,802,666.72	556,924,064.23
项目	上年度可比期间		
	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

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

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
邓召明

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
刘慧红

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 2014 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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 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

本基金本报告期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 2014年6月30日
活期存款	30,370,681.69
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	30,370,681.69

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	515,217,642.36	528,286,700.78	13,069,058.42
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	515,217,642.36	528,286,700.78	13,069,058.42

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截止本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截止本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：截止本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	6,490.36
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	592.74
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	101.16
合计	7,184.26

注：其他为应收结算保证金利息。

**6.4.7.6 其他资产**

注：截止本报告期末，本基金未持有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	802,916.27
银行间市场应付交易费用	-
合计	802,916.27

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	884.57
预提费用	221,167.52
指数使用费	50,000.00
其他应付款其他	6,000.00
合计	278,052.09

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	761,808,825.91	761,808,825.91
本期申购	312,601,842.42	312,601,842.42
本期赎回(以“-”号填列)	-381,683,937.38	-381,683,937.38
本期末	692,726,730.95	692,726,730.95

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	-124,956,440.05	-28,573,807.30	-153,530,247.35
本期利润	21,337,776.70	-8,568,813.42	12,768,963.28
本期基金份额交易产生的变动数	6,862,592.04	-1,903,974.69	4,958,617.35
其中：基金申购款	-51,152,539.57	-13,012,190.30	-64,164,729.87
基金赎回款	58,015,131.61	11,108,215.61	69,123,347.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-96,756,071.31	-39,046,595.41	-135,802,666.72

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	121,575.02
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	12,636.07
其他	25,186.93
合计	159,398.02

注：其他为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 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
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,047,379,903.09
减: 卖出股票成本总额	1,024,403,201.71
买卖股票差价收入	22,976,701.38

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位: 人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
卖出债券 (债转股及债券到期兑付) 成交总额	179,417.45
减: 卖出债券 (债转股及债券到期兑付) 成本总额	169,500.00
减: 应收利息总额	181.30
债券投资收益	9,736.15

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

注: 本基金本报告期没有发生衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,098,198.71
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,098,198.71

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-8,568,813.42
—— 股票投资	-8,568,813.42
—— 债券投资	-
—— 资产支持证券投资	-
—— 贵金属投资	-
—— 其他	-

2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-8,568,813.42

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	325,010.34
转换费收入	7,823.53
合计	332,833.87

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	3,116,724.99
银行间市场交易费用	-
合计	3,116,724.99

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	42,647.22
信息披露费	148,767.52
其他	400.00
上市年费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
银行汇划费用	416.00
合计	321,983.52

注：其他为上海清算所数字证书费。

### 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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	689,562,814.62	33.95%	25,368,399.48	1.37%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

注：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

注：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

注：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 2014年1月1日至2014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	627,782.88	34.46%	139,807.09	17.41%
关联方名称	上年度可比期间 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%

注：(1) 佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1%-买(卖)经手费-买(卖)证管费等由券商承担的费用

深圳证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1%-买(卖)经手费-买(卖)证管费等由券商承担的费用

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

(2) 本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易单元租用协议》。根据协议规定,上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6 月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,333,803.54
其中:支付销售机构的客户维护费	566,193.07	623,635.54

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
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	466,760.68	600,123.96

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

注：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

注：本基金本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未投资、持有本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期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	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		2013 年 1 月 1 日至 2013 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
工商银行	30,370,681.69	121,575.02	39,108,611.95	170,272.92

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期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

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：截至本报告期末，本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限股票，也没有持有因认购新发或增发而流通受限债券及权证。

##### 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
600418	江淮汽车	2014 年 4 月 14 日	资产重组	10.20	2014 年 7 月 11 日	11.22	264,368	2,152,849.97	2,696,553.60	-
000762	西藏矿业	2014 年 4 月 29 日	资产重组	10.54	2014 年 7 月 28 日	11.59	183,262	2,100,315.39	1,931,581.48	-
600755	厦门国贸	2014 年 6 月 27 日	配股发行	4.85	2014 年 7 月 7 日	4.74	362,943	1,835,684.86	1,760,273.55	-
002252	上海莱士	2014 年 6 月 13 日	资产重组	63.30	-	-	27,594	1,074,030.61	1,746,700.20	-
600864	哈投股份	2014 年 4 月 11 日	资产重组	8.68	2014 年 7 月 15 日	8.30	190,233	1,691,006.10	1,651,222.44	-
002167	东方锆业	2014 年 1 月 1 日	资产重组	11.39	2014 年 7 月 1 日	11.10	93,902	950,609.97	1,069,543.78	-
002340	格林美	2014 年 6 月 26 日	重大事项	11.19	2014 年 7 月 24 日	11.77	94,232	999,526.58	1,054,456.08	-
600490	鹏欣资源	2014 年 4 月 1 日	重大事项	6.11	2014 年 7 月 15 日	6.11	163,832	1,034,741.11	1,001,013.52	-
600685	广船国际	2014 年 4 月 8 日	资产重组	17.13	-	-	48,862	735,263.35	837,006.06	-
000612	焦作万方	2014 年 4 月 3 日	重大事项	6.08	2014 年 8 月 18 日	6.69	129,662	716,201.08	788,344.96	-
601012	隆基股份	2014 年 6 月 19 日	重大事项	15.50	2014 年 7 月 1 日	15.60	49,600	685,198.24	768,800.00	-
002638	勤上光电	2014 年 6 月 10 日	重大事项	14.15	2014 年 7 月 15 日	14.75	42,446	561,625.47	600,610.90	-
600582	天地科技	2014 年 6 月 26 日	资产重组	7.97	-	-	72,100	652,529.69	574,637.00	-
600850	华东电脑	2014 年 4 月 4 日	资产重组	19.56	2014 年 7 月 11 日	21.52	26,605	543,137.40	520,393.80	-
601777	力帆股份	2014 年 6 月 24 日	重大事项	6.39	2014 年 7 月 8 日	6.70	80,430	526,529.24	513,947.70	-
600757	长江传媒	2014 年 6 月 17 日	重大事项	8.85	-	-	57,244	491,095.74	506,609.40	-
600260	凯乐科技	2014 年 6 月 9 日	资产重组	6.59	-	-	66,759	514,087.70	439,941.81	-
000852	江钻股份	2014 年 5 月 28 日	重大事项	15.80	-	-	25,326	421,847.96	400,150.80	-
002635	安洁科技	2014 年 6 月 30 日	重大事项	31.99	2014 年 8 月 5 日	35.19	10,950	381,003.44	350,290.50	-
600059	古越龙山	2014 年 6 月 30 日	临时停牌	7.97	2014 年 7 月 1 日	7.83	74,888	669,956.41	596,857.36	-

600507	方大特钢	2014 年 6 月 30 日	临时停牌	3.16	2014 年 7 月 2 日	3.03	462,481	1,564,270.54	1,461,439.96	-
--------	------	-----------------	------	------	----------------	------	---------	--------------	--------------	---

### 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 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2013 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 2014 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	30,370,681.69	-	-	-	30,370,681.69
结算备付金	1,463,493.57	-	-	-	1,463,493.57
存出保证金	249,830.58	-	-	-	249,830.58
交易性金融资产	-	-	-	528,286,700.78	528,286,700.78
应收证券清算款	-	-	-	971,902.19	971,902.19
应收利息	-	-	-	7,184.26	7,184.26
应收申购款	-	-	-	29,757.47	29,757.47
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	32,084,005.84	-	-	529,295,544.70	561,379,550.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,966,799.89	2,966,799.89
应付管理人报酬	-	-	-	339,765.05	339,765.05
应付托管费	-	-	-	67,953.01	67,953.01
应付交易费用	-	-	-	802,916.27	802,916.27
其他负债	-	-	-	278,052.09	278,052.09
负债总计	-	-	-	4,455,486.31	4,455,486.31
利率敏感度缺口	32,084,005.84	-	-	524,840,058.39	556,924,064.23
上年度末 2013 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	32,451,836.75	-	-	-	32,451,836.75
结算备付金	3,317.92	-	-	-	3,317.92
存出保证金	226,993.72	-	-	-	226,993.72
交易性金融资产	-	-	-	577,821,387.58	577,821,387.58
应收证券清算款	-	-	-	1,919,946.80	1,919,946.80
应收利息	-	-	-	6,525.15	6,525.15

应收申购款	-	-	-	100,721.98	100,721.98
资产总计	32,682,148.39	-	-	579,848,581.51	612,530,729.90
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,224,790.98	2,224,790.98
应付赎回款	-	-	-	596,208.71	596,208.71
应付管理人报酬	-	-	-	399,781.16	399,781.16
应付托管费	-	-	-	79,956.22	79,956.22
应付交易费用	-	-	-	609,120.22	609,120.22
其他负债	-	-	-	342,294.05	342,294.05
负债总计	-	-	-	4,252,151.34	4,252,151.34
利率敏感度缺口	32,682,148.39	-	-	575,596,430.17	608,278,578.56

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2013 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（2013 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 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 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	528,286,700.78	94.86	577,821,387.58	94.99
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	528,286,700.78	94.86	577,821,387.58	94.99

#### 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 (2014 年 6 月 30 日)	上年度末 (2013 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5	26,117,510.92	30,231,445.35
	业绩比较基准下降 5	-26,117,510.92	-30,231,445.35

#### 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 2014 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 507,016,325.88 元，属于第二层级的余额为 21,270,374.90 元，无属于第三层级的余额(2013 年 12 月 31 日：第一层级 564,047,403.77 元，第二层级 13,773,983.81 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

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	528,286,700.78	94.11
	其中：股票	528,286,700.78	94.11
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	31,834,175.26	5.67



7	其他各项资产	1,258,674.50	0.22
8	合计	561,379,550.54	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	7,637,951.11	1.37
B	采矿业	18,450,819.46	3.31
C	制造业	320,644,669.83	57.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,555,221.13	2.97
E	建筑业	12,070,260.08	2.17
F	批发和零售业	37,577,665.62	6.75
G	交通运输、仓储和邮政业	14,560,984.03	2.61
H	住宿和餐饮业	1,322,153.70	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,303,830.91	5.44
J	金融业	10,562,160.92	1.90
K	房地产业	35,556,309.25	6.38
L	租赁和商务服务业	7,218,414.35	1.30
M	科学研究和技术服务业	1,173,797.25	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	4,951,199.03	0.89
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	6,086,459.39	1.09
S	综合	3,601,974.72	0.65
	合计	528,273,870.78	94.86

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	12,830.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,830.00	0.00

### 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	002152	广电运通	294,683	5,021,398.32	0.90
2	600570	恒生电子	163,159	4,796,874.60	0.86
3	600879	航天电子	310,895	3,662,343.10	0.66
4	600761	安徽合力	357,589	3,518,675.76	0.63
5	002063	远光软件	163,972	3,353,227.40	0.60
6	002250	联化科技	235,249	3,340,535.80	0.60
7	600563	法拉电子	98,740	3,283,105.00	0.59
8	600675	中华企业	627,326	3,042,531.10	0.55
9	002405	四维图新	179,883	2,989,655.46	0.54
10	000559	万向钱潮	286,903	2,949,362.84	0.53
11	600704	物产中大	353,884	2,930,159.52	0.53
12	600587	新华医疗	39,267	2,927,354.85	0.53
13	601519	大智慧	497,498	2,920,313.26	0.52
14	000415	渤海租赁	380,145	2,919,513.60	0.52
15	600038	哈飞股份	100,592	2,799,475.36	0.50

16	000021	长城开发	468,854	2,766,238.60	0.50
17	000690	宝新能源	668,857	2,728,936.56	0.49
18	002191	劲嘉股份	204,960	2,725,968.00	0.49
19	600418	江淮汽车	264,368	2,696,553.60	0.48
20	600765	中航重机	223,628	2,683,536.00	0.48
21	600572	康恩贝	191,193	2,651,846.91	0.48
22	000848	承德露露	132,089	2,624,608.43	0.47
23	600251	冠农股份	175,463	2,623,171.85	0.47
24	000563	陕国投 A	406,216	2,611,968.88	0.47
25	600366	宁波韵升	174,746	2,593,230.64	0.47
26	601311	骆驼股份	240,552	2,578,717.44	0.46
27	600522	中天科技	195,718	2,561,948.62	0.46
28	600435	北方导航	208,744	2,557,114.00	0.46
29	600517	置信电气	250,532	2,545,405.12	0.46
30	002022	科华生物	109,754	2,529,829.70	0.45
31	600872	中炬高新	235,000	2,507,450.00	0.45
32	002701	奥瑞金	123,598	2,492,971.66	0.45
33	002153	石基信息	48,541	2,490,153.30	0.45
34	000712	锦龙股份	166,018	2,478,648.74	0.45
35	002646	青青稞酒	155,375	2,406,758.75	0.43
36	600993	马应龙	149,603	2,350,263.13	0.42
37	000977	浪潮信息	66,532	2,340,595.76	0.42
38	600525	长园集团	211,381	2,333,646.24	0.42
39	603766	隆鑫通用	261,087	2,308,009.08	0.41
40	000951	中国重汽	196,066	2,307,696.82	0.41
41	000685	中山公用	222,397	2,261,777.49	0.41
42	600004	白云机场	320,358	2,255,320.32	0.40
43	600643	爱建股份	243,850	2,240,981.50	0.40
44	002064	华峰氨纶	261,061	2,234,682.16	0.40
45	000418	小天鹅 A	218,815	2,234,101.15	0.40
46	000786	北新建材	159,612	2,189,876.64	0.39
47	000066	长城电脑	515,031	2,173,430.82	0.39
48	600139	西部资源	156,867	2,164,764.60	0.39
49	000572	海马汽车	577,801	2,137,863.70	0.38
50	600184	光电股份	100,871	2,128,378.10	0.38
51	600312	平高电气	148,920	2,075,944.80	0.37
52	000969	安泰科技	223,674	2,057,800.80	0.37
53	603366	日出东方	150,269	2,030,134.19	0.36
54	600037	歌华有线	191,566	2,015,274.32	0.36

55	002041	登海种业	71,898	2,001,640.32	0.36
56	600835	上海机电	127,246	1,982,492.68	0.36
57	002025	航天电器	125,915	1,975,606.35	0.35
58	600536	中国软件	91,275	1,962,412.50	0.35
59	000088	盐田港	382,972	1,945,497.76	0.35
60	002013	中航机电	130,642	1,934,808.02	0.35
61	000762	西藏矿业	183,262	1,931,581.48	0.35
62	000809	铁岭新城	161,267	1,914,239.29	0.34
63	600511	国药股份	84,022	1,907,299.40	0.34
64	002424	贵州百灵	77,146	1,902,420.36	0.34
65	000799	酒鬼酒	172,557	1,882,596.87	0.34
66	000998	隆平高科	68,251	1,875,537.48	0.34
67	002440	闰土股份	101,254	1,873,199.00	0.34
68	600654	飞乐股份	206,879	1,872,254.95	0.34
69	600816	安信信托	129,812	1,869,292.80	0.34
70	600628	新世界	239,269	1,856,727.44	0.33
71	000655	金岭矿业	270,177	1,856,115.99	0.33
72	000550	江铃汽车	62,756	1,818,668.88	0.33
73	002219	恒康医疗	82,611	1,815,789.78	0.33
74	002048	宁波华翔	121,144	1,805,045.60	0.32
75	600426	华鲁恒升	248,274	1,787,572.80	0.32
76	600183	生益科技	286,029	1,761,938.64	0.32
77	601678	滨化股份	235,392	1,760,732.16	0.32
78	600755	厦门国贸	362,943	1,760,273.55	0.32
79	600199	金种子酒	251,019	1,759,643.19	0.32
80	002252	上海莱士	27,594	1,746,700.20	0.31
81	600748	上实发展	234,771	1,744,348.53	0.31
82	600657	信达地产	550,215	1,744,181.55	0.31
83	600885	宏发股份	78,554	1,725,831.38	0.31
84	600067	冠城大通	336,820	1,687,468.20	0.30
85	002648	卫星石化	117,866	1,686,662.46	0.30
86	000926	福星股份	257,125	1,676,455.00	0.30
87	601801	皖新传媒	125,218	1,674,164.66	0.30
88	002233	塔牌集团	274,152	1,661,361.12	0.30
89	600864	哈投股份	190,233	1,651,222.44	0.30
90	600200	江苏吴中	157,794	1,639,479.66	0.29
91	600750	江中药业	102,471	1,605,720.57	0.29
92	600820	隧道股份	330,830	1,604,525.50	0.29
93	002393	力生制药	53,993	1,576,055.67	0.28

94	000897	津滨发展	311,722	1,561,727.22	0.28
95	600673	东阳光科	126,419	1,548,632.75	0.28
96	002190	成飞集成	26,086	1,539,074.00	0.28
97	600801	华新水泥	229,007	1,527,476.69	0.27
98	600805	悦达投资	165,675	1,522,553.25	0.27
99	600557	康缘药业	52,925	1,518,947.50	0.27
100	600422	昆明制药	71,157	1,495,008.57	0.27
101	002437	誉衡药业	29,004	1,493,706.00	0.27
102	600584	长电科技	169,041	1,492,632.03	0.27
103	600521	华海药业	134,357	1,484,644.85	0.27
104	000501	鄂武商 A	126,804	1,483,606.80	0.27
105	002203	海亮股份	134,563	1,481,538.63	0.27
106	600261	阳光照明	149,909	1,481,100.92	0.27
107	600507	方大特钢	462,481	1,461,439.96	0.26
108	000543	皖能电力	219,427	1,448,218.20	0.26
109	000525	红太阳	103,103	1,444,473.03	0.26
110	600151	航天机电	188,943	1,443,524.52	0.26
111	600021	上海电力	330,097	1,442,523.89	0.26
112	600729	重庆百货	73,671	1,439,531.34	0.26
113	000829	天音控股	168,495	1,425,467.70	0.26
114	002327	富安娜	127,494	1,419,008.22	0.25
115	001696	宗申动力	310,888	1,408,322.64	0.25
116	000975	银泰资源	175,286	1,397,029.42	0.25
117	000726	鲁泰 A	158,607	1,394,155.53	0.25
118	000030	富奥股份	215,476	1,389,820.20	0.25
119	600601	方正科技	433,601	1,383,187.19	0.25
120	000631	顺发恒业	304,529	1,376,471.08	0.25
121	002317	众生药业	68,694	1,371,819.18	0.25
122	002315	焦点科技	31,976	1,364,096.16	0.24
123	601099	太平洋	213,700	1,361,269.00	0.24
124	600270	外运发展	112,122	1,354,433.76	0.24
125	600780	通宝能源	313,838	1,352,641.78	0.24
126	002249	大洋电机	97,058	1,349,106.20	0.24
127	600197	伊力特	149,147	1,348,288.88	0.24
128	600201	金宇集团	43,300	1,347,496.00	0.24
129	600064	南京高科	124,690	1,340,417.50	0.24
130	002092	中泰化学	215,568	1,332,210.24	0.24
131	600770	综艺股份	143,175	1,325,800.50	0.24
132	000028	国药一致	33,143	1,324,062.85	0.24

133	002223	鱼跃医疗	54,561	1,323,104.25	0.24
134	002271	东方雨虹	53,236	1,322,914.60	0.24
135	600754	锦江股份	80,570	1,322,153.70	0.24
136	000050	深天马 A	105,173	1,314,662.50	0.24
137	002508	老板电器	46,462	1,313,480.74	0.24
138	600138	中青旅	60,106	1,309,108.68	0.24
139	600397	安源煤业	385,526	1,306,933.14	0.23
140	002273	水晶光电	70,231	1,285,227.30	0.23
141	600509	天富热电	157,617	1,271,969.19	0.23
142	002396	星网锐捷	44,858	1,255,575.42	0.23
143	002428	云南锗业	103,378	1,253,975.14	0.23
144	600398	海澜之家	136,000	1,251,200.00	0.22
145	600967	北方创业	99,600	1,249,980.00	0.22
146	002573	国电清新	70,926	1,246,879.08	0.22
147	600162	香江控股	268,459	1,245,649.76	0.22
148	002005	德豪润达	147,930	1,238,174.10	0.22
149	002368	太极股份	36,594	1,225,533.06	0.22
150	600110	中科英华	231,651	1,216,167.75	0.22
151	600039	四川路桥	212,625	1,186,447.50	0.21
152	600491	龙元建设	360,263	1,185,265.27	0.21
153	000887	中鼎股份	122,698	1,185,262.68	0.21
154	000518	四环生物	367,888	1,180,920.48	0.21
155	000652	泰达股份	305,104	1,180,752.48	0.21
156	002414	高德红外	64,850	1,179,621.50	0.21
157	002275	桂林三金	77,658	1,178,848.44	0.21
158	600056	中国医药	110,794	1,177,740.22	0.21
159	000511	烯碳新材	174,724	1,177,639.76	0.21
160	600635	大众公用	245,425	1,175,585.75	0.21
161	600645	中源协和	42,299	1,173,797.25	0.21
162	002305	南国置业	192,921	1,167,172.05	0.21
163	600830	香溢融通	149,657	1,152,358.90	0.21
164	002588	史丹利	56,005	1,148,102.50	0.21
165	600825	新华传媒	146,921	1,147,453.01	0.21
166	002226	江南化工	107,791	1,143,662.51	0.21
167	600125	铁龙物流	237,263	1,143,607.66	0.21
168	002285	世联行	141,771	1,135,585.71	0.20
169	600694	大商股份	44,400	1,133,532.00	0.20
170	002049	同方国芯	47,722	1,133,397.50	0.20
171	600759	正和股份	110,822	1,132,600.84	0.20

172	002056	横店东磁	58,102	1,130,664.92	0.20
173	002179	中航光电	64,246	1,127,517.30	0.20
174	600724	宁波富达	284,339	1,120,295.66	0.20
175	601000	唐山港	252,578	1,106,291.64	0.20
176	600325	华发股份	177,453	1,101,983.13	0.20
177	601718	际华集团	445,617	1,096,217.82	0.20
178	601515	东风股份	92,163	1,094,896.44	0.20
179	601126	四方股份	76,240	1,082,608.00	0.19
180	600858	银座股份	153,729	1,077,640.29	0.19
181	000697	炼石有色	77,477	1,071,506.91	0.19
182	002167	东方锆业	93,902	1,069,543.78	0.19
183	600298	安琪酵母	73,147	1,066,483.26	0.19
184	600596	新安股份	115,788	1,059,460.20	0.19
185	600881	亚泰集团	286,668	1,054,938.24	0.19
186	002340	格林美	94,232	1,054,456.08	0.19
187	000886	海南高速	242,578	1,050,362.74	0.19
188	002237	恒邦股份	82,202	1,049,719.54	0.19
189	600811	东方集团	201,800	1,047,342.00	0.19
190	000426	兴业矿业	109,220	1,044,143.20	0.19
191	002663	普邦园林	86,556	1,035,209.76	0.19
192	000900	现代投资	224,486	1,034,880.46	0.19
193	601636	旗滨集团	143,785	1,029,500.60	0.18
194	000688	建新矿业	195,689	1,019,539.69	0.18
195	600614	鼎立股份	101,021	1,014,250.84	0.18
196	002690	美亚光电	28,712	1,012,672.24	0.18
197	600175	美都控股	176,000	1,012,000.00	0.18
198	000049	德赛电池	25,107	1,008,548.19	0.18
199	600490	鹏欣资源	163,832	1,001,013.52	0.18
200	002277	友阿股份	104,741	995,039.50	0.18
201	002482	广田股份	83,026	993,821.22	0.18
202	600456	宝钛股份	66,917	993,048.28	0.18
203	000422	湖北宜化	196,905	986,494.05	0.18
204	600776	东方通信	73,402	979,916.70	0.18
205	002384	东山精密	96,756	978,203.16	0.18
206	002078	太阳纸业	309,294	974,276.10	0.17
207	600120	浙江东方	86,081	972,715.30	0.17
208	601566	九牧王	92,188	971,661.52	0.17
209	600747	大连控股	155,145	963,450.45	0.17
210	002408	齐翔腾达	68,940	961,023.60	0.17

211	002267	陕天然气	105,545	960,459.50	0.17
212	600158	中体产业	102,136	958,035.68	0.17
213	002004	华邦颖泰	51,159	951,557.40	0.17
214	000513	丽珠集团	19,932	941,388.36	0.17
215	000997	新大陆	54,037	938,082.32	0.17
216	600844	丹化科技	157,749	935,451.57	0.17
217	000650	仁和药业	196,369	932,752.75	0.17
218	000417	合肥百货	180,249	931,887.33	0.17
219	600410	华胜天成	78,216	929,988.24	0.17
220	002325	洪涛股份	113,354	929,502.80	0.17
221	002262	恩华药业	41,785	928,044.85	0.17
222	600787	中储股份	70,367	919,696.69	0.17
223	000603	盛达矿业	77,861	919,538.41	0.17
224	000587	金叶珠宝	88,582	919,481.16	0.17
225	002266	浙富控股	129,500	918,155.00	0.16
226	600740	山西焦化	174,738	912,132.36	0.16
227	600351	亚宝药业	99,123	911,931.60	0.16
228	002238	天威视讯	72,711	911,068.83	0.16
229	600487	亨通光电	63,286	910,052.68	0.16
230	002161	远望谷	116,520	897,204.00	0.16
231	000719	大地传媒	75,664	896,618.40	0.16
232	002251	步步高	69,517	895,378.96	0.16
233	601965	中国汽研	72,365	895,155.05	0.16
234	000732	泰禾集团	104,549	892,848.46	0.16
235	000988	华工科技	94,389	886,312.71	0.16
236	600432	吉恩镍业	61,352	885,922.88	0.16
237	600978	宜华木业	179,554	876,223.52	0.16
238	600884	杉杉股份	50,919	875,297.61	0.16
239	600239	云南城投	200,903	865,891.93	0.16
240	600428	中远航运	295,322	865,293.46	0.16
241	600478	科力远	38,067	862,598.22	0.15
242	600797	浙大网新	125,837	861,983.45	0.15
243	002073	软控股份	89,914	860,476.98	0.15
244	002293	罗莱家纺	42,793	860,139.30	0.15
245	600545	新疆城建	104,642	858,064.40	0.15
246	600479	千金药业	74,203	855,560.59	0.15
247	600894	广日股份	76,662	845,581.86	0.15
248	601999	出版传媒	106,606	845,385.58	0.15
249	000939	凯迪电力	114,222	845,242.80	0.15



250	600392	盛和资源	46,674	839,198.52	0.15
251	600017	日照港	323,507	837,883.13	0.15
252	600685	广船国际	48,862	837,006.06	0.15
253	002447	壹桥苗业	67,570	830,435.30	0.15
254	600699	均胜电子	32,942	827,832.46	0.15
255	600651	飞乐音响	111,791	827,253.40	0.15
256	000788	北大医药	54,070	820,782.60	0.15
257	600195	中牧股份	62,797	816,988.97	0.15
258	000735	罗牛山	133,221	815,312.52	0.15
259	002557	洽洽食品	48,986	812,187.88	0.15
260	600500	中化国际	126,073	811,910.12	0.15
261	002028	思源电气	85,736	805,918.40	0.14
262	002392	北京利尔	87,580	804,860.20	0.14
263	600611	大众交通	122,058	801,921.06	0.14
264	600320	振华重工	251,304	801,659.76	0.14
265	600198	大唐电信	53,396	795,600.40	0.14
266	000541	佛山照明	79,766	794,469.36	0.14
267	600537	亿晶光电	76,658	791,110.56	0.14
268	600112	天成控股	61,621	789,981.22	0.14
269	000669	金鸿能源	45,956	789,524.08	0.14
270	002155	辰州矿业	105,500	789,140.00	0.14
271	600284	浦东建设	83,850	789,028.50	0.14
272	000612	焦作万方	129,662	788,344.96	0.14
273	000823	超声电子	64,806	786,096.78	0.14
274	000566	海南海药	72,177	785,285.76	0.14
275	000078	海王生物	105,511	781,836.51	0.14
276	601012	隆基股份	49,600	768,800.00	0.14
277	601908	京运通	107,711	767,979.43	0.14
278	600790	轻纺城	85,215	765,230.70	0.14
279	600438	通威股份	80,434	763,318.66	0.14
280	002308	威创股份	112,359	750,558.12	0.13
281	002309	中利科技	42,958	747,039.62	0.13
282	000510	金路集团	113,056	742,777.92	0.13
283	000552	靖远煤电	91,379	741,997.48	0.13
284	000860	顺鑫农业	52,088	731,315.52	0.13
285	600169	太原重工	256,800	729,312.00	0.13
286	002490	山东墨龙	85,242	724,557.00	0.13
287	600176	中国玻纤	93,177	723,053.52	0.13
288	002463	沪电股份	223,719	722,612.37	0.13

289	002371	七星电子	35,973	721,618.38	0.13
290	002091	江苏国泰	46,950	718,804.50	0.13
291	600161	天坛生物	38,967	716,213.46	0.13
292	002595	豪迈科技	15,100	711,965.00	0.13
293	000680	山推股份	247,877	706,449.45	0.13
294	600387	海越股份	46,780	705,442.40	0.13
295	600503	华丽家族	172,340	703,147.20	0.13
296	000409	山东地矿	76,812	698,989.20	0.13
297	002083	孚日股份	170,549	697,545.41	0.13
298	000671	阳光城	79,022	694,603.38	0.12
299	000528	柳工	119,200	693,744.00	0.12
300	000616	亿城投资	216,440	688,279.20	0.12
301	600122	宏图高科	138,182	688,146.36	0.12
302	600292	中电远达	35,864	682,850.56	0.12
303	000930	中粮生化	184,047	682,814.37	0.12
304	601608	中信重工	214,471	671,294.23	0.12
305	002477	雏鹰农牧	71,004	668,147.64	0.12
306	000759	中百集团	82,414	667,553.40	0.12
307	600171	上海贝岭	81,562	665,545.92	0.12
308	600160	巨化股份	137,000	663,080.00	0.12
309	002181	粤传媒	41,840	661,072.00	0.12
310	600073	上海梅林	90,676	659,214.52	0.12
311	600322	天房发展	191,965	656,520.30	0.12
312	000006	深振业 A	143,015	655,008.70	0.12
313	600640	号百控股	37,887	653,171.88	0.12
314	002183	怡亚通	84,461	652,883.53	0.12
315	002052	同洲电子	72,300	649,977.00	0.12
316	002154	报喜鸟	111,760	647,090.40	0.12
317	600743	华远地产	231,860	644,570.80	0.12
318	600580	卧龙电气	83,986	644,172.62	0.12
319	600220	江苏阳光	215,858	641,098.26	0.12
320	600335	国机汽车	40,707	639,506.97	0.11
321	601208	东材科技	94,436	637,443.00	0.11
322	002050	三花股份	58,481	635,103.66	0.11
323	002140	东华科技	37,569	632,286.27	0.11
324	600240	华业地产	129,354	631,247.52	0.11
325	000919	金陵药业	44,910	625,147.20	0.11
326	002431	棕榈园林	34,900	621,220.00	0.11
327	600289	亿阳信通	69,222	619,536.90	0.11

328	600180	瑞茂通	58,671	618,979.05	0.11
329	002093	国脉科技	93,550	618,365.50	0.11
330	600458	时代新材	70,090	618,193.80	0.11
331	600983	合肥三洋	47,606	617,925.88	0.11
332	600280	中央商场	61,197	617,477.73	0.11
333	600416	湘电股份	64,421	616,508.97	0.11
334	601616	广电电气	172,687	616,492.59	0.11
335	002018	华星化工	72,600	615,648.00	0.11
336	600409	三友化工	140,002	611,808.74	0.11
337	601717	郑煤机	125,100	607,986.00	0.11
338	600812	华北制药	123,434	606,060.94	0.11
339	600482	风帆股份	56,600	605,620.00	0.11
340	600187	国中水务	132,200	605,476.00	0.11
341	600266	北京城建	80,700	602,829.00	0.11
342	600054	黄山旅游	47,197	601,761.75	0.11
343	002069	獐子岛	43,000	601,140.00	0.11
344	002638	勤上光电	42,446	600,610.90	0.11
345	600612	老凤祥	23,694	599,695.14	0.11
346	600481	双良节能	61,283	598,734.91	0.11
347	600815	厦工股份	163,695	597,486.75	0.11
348	600059	古越龙山	74,888	596,857.36	0.11
349	000933	神火股份	172,500	596,850.00	0.11
350	000540	中天城投	116,855	595,960.50	0.11
351	000488	晨鸣纸业	135,706	591,678.16	0.11
352	600551	时代出版	35,430	590,618.10	0.11
353	600720	祁连山	93,954	589,091.58	0.11
354	002168	深圳惠程	80,234	588,917.56	0.11
355	002254	泰和新材	69,603	588,145.35	0.11
356	002444	巨星科技	61,395	583,252.50	0.10
357	600851	海欣股份	89,404	580,231.96	0.10
358	600582	天地科技	72,100	574,637.00	0.10
359	002345	潮宏基	33,517	573,811.04	0.10
360	600086	东方金钰	31,974	571,055.64	0.10
361	000877	天山股份	93,248	569,745.28	0.10
362	000921	海信科龙	65,482	569,693.40	0.10
363	601233	桐昆股份	92,269	565,608.97	0.10
364	002194	武汉凡谷	44,332	565,233.00	0.10
365	600460	士兰微	94,369	558,664.48	0.10
366	000816	江淮动力	128,861	556,679.52	0.10

367	601369	陕鼓动力	99,200	556,512.00	0.10
368	002029	七匹狼	68,559	553,956.72	0.10
369	000987	广州友谊	60,703	553,004.33	0.10
370	600859	王府井	35,000	553,000.00	0.10
371	000982	中银绒业	75,877	550,108.25	0.10
372	002118	紫鑫药业	38,775	548,666.25	0.10
373	600575	芜湖港	147,356	548,164.32	0.10
374	600132	重庆啤酒	36,664	547,026.88	0.10
375	601100	恒立油缸	59,018	546,506.68	0.10
376	000830	鲁西化工	155,127	546,047.04	0.10
377	600566	洪城股份	23,600	545,160.00	0.10
378	000973	佛塑科技	102,506	541,231.68	0.10
379	600723	首商股份	86,451	530,809.14	0.10
380	002311	海大集团	48,200	530,682.00	0.10
381	000667	美好集团	309,891	529,913.61	0.10
382	600329	中新药业	33,996	526,598.04	0.09
383	000031	中粮地产	161,337	525,958.62	0.09
384	600874	创业环保	65,839	523,420.05	0.09
385	000777	中核科技	45,545	523,312.05	0.09
386	600401	海润光伏	65,506	522,737.88	0.09
387	600850	华东电脑	26,605	520,393.80	0.09
388	000979	中弘股份	174,590	518,532.30	0.09
389	600141	兴发集团	52,748	517,457.88	0.09
390	600268	国电南自	104,247	517,065.12	0.09
391	002498	汉缆股份	71,622	514,245.96	0.09
392	601777	力帆股份	80,430	513,947.70	0.09
393	600636	三爱富	40,476	511,211.88	0.09
394	600528	中铁二局	110,400	511,152.00	0.09
395	600300	维维股份	126,522	511,148.88	0.09
396	000636	风华高科	81,272	507,137.28	0.09
397	600757	长江传媒	57,244	506,609.40	0.09
398	002011	盾安环境	63,805	505,973.65	0.09
399	002672	东江环保	18,495	505,468.35	0.09
400	601002	晋亿实业	59,969	503,739.60	0.09
401	002281	光迅科技	14,520	499,342.80	0.09
402	600616	金枫酒业	63,394	494,473.20	0.09
403	600389	江山股份	15,000	489,150.00	0.09
404	600311	荣华实业	100,686	485,306.52	0.09
405	002714	牧原股份	11,000	484,550.00	0.09

406	600826	兰生股份	31,856	472,105.92	0.08
407	600380	健康元	93,535	471,416.40	0.08
408	002123	荣信股份	61,008	467,931.36	0.08
409	601010	文峰股份	66,929	467,164.42	0.08
410	600026	中海发展	114,156	461,190.24	0.08
411	600831	广电网络	59,647	461,071.31	0.08
412	000099	中信海直	51,622	457,370.92	0.08
413	002242	九阳股份	46,100	455,468.00	0.08
414	002698	博实股份	18,224	454,142.08	0.08
415	600823	世茂股份	53,100	453,474.00	0.08
416	600970	中材国际	66,200	451,484.00	0.08
417	000090	天健集团	58,529	451,258.59	0.08
418	002358	森源电气	18,100	449,966.00	0.08
419	002276	万马股份	71,001	448,016.31	0.08
420	002572	索菲亚	27,037	444,488.28	0.08
421	000850	华茂股份	85,706	442,242.96	0.08
422	600586	金晶科技	150,668	439,950.56	0.08
423	600260	凯乐科技	66,759	439,941.81	0.08
424	002216	三全食品	24,343	439,391.15	0.08
425	601886	江河创建	69,900	436,875.00	0.08
426	002461	珠江啤酒	30,852	435,630.24	0.08
427	002378	章源钨业	24,702	434,261.16	0.08
428	000931	中关村	81,688	429,678.88	0.08
429	000627	天茂集团	163,876	429,355.12	0.08
430	002320	海峡股份	48,521	427,955.22	0.08
431	600702	沱牌舍得	40,827	427,458.69	0.08
432	600088	中视传媒	29,312	425,610.24	0.08
433	600006	东风汽车	141,991	423,133.18	0.08
434	002122	天马股份	89,837	422,233.90	0.08
435	002430	杭氧股份	60,162	409,703.22	0.07
436	601101	昊华能源	72,600	408,738.00	0.07
437	600997	开滦股份	93,400	407,224.00	0.07
438	600496	精工钢构	62,163	405,924.39	0.07
439	600639	浦东金桥	39,711	404,257.98	0.07
440	600971	恒源煤电	75,700	404,238.00	0.07
441	601880	大连港	152,653	401,477.39	0.07
442	000852	江钻股份	25,326	400,150.80	0.07
443	002221	东华能源	35,509	397,345.71	0.07
444	600425	青松建化	83,410	392,861.10	0.07

445	002128	露天煤业	60,200	391,300.00	0.07
446	002342	巨力索具	72,588	390,523.44	0.07
447	600510	黑牡丹	74,713	388,507.60	0.07
448	000693	华泽钴镍	16,400	388,352.00	0.07
449	600439	瑞贝卡	99,884	387,549.92	0.07
450	600429	三元股份	53,579	387,376.17	0.07
451	000962	东方钨业	40,003	381,628.62	0.07
452	600736	苏州高新	96,013	373,490.57	0.07
453	002204	大连重工	29,200	372,592.00	0.07
454	002574	明牌珠宝	14,547	370,803.03	0.07
455	002332	仙琚制药	46,485	370,020.60	0.07
456	002480	新筑股份	50,888	365,884.72	0.07
457	600467	好当家	66,273	361,187.85	0.06
458	002635	安洁科技	10,950	350,290.50	0.06
459	002244	滨江集团	61,400	348,138.00	0.06
460	600803	威远生化	29,800	348,064.00	0.06
461	002225	濮耐股份	65,510	346,547.90	0.06
462	000703	恒逸石化	52,400	345,316.00	0.06
463	600773	西藏城投	34,854	344,706.06	0.06
464	600508	上海能源	43,720	344,513.60	0.06
465	002479	富春环保	44,606	343,466.20	0.06
466	601339	百隆东方	42,313	342,312.17	0.06
467	600337	美克股份	58,714	337,018.36	0.06
468	600963	岳阳林纸	111,803	336,527.03	0.06
469	600078	澄星股份	60,200	335,916.00	0.06
470	000596	古井贡酒	17,400	331,818.00	0.06
471	000506	中润资源	84,325	325,494.50	0.06
472	002601	佰利联	17,273	319,550.50	0.06
473	002075	沙钢股份	82,873	319,061.05	0.06
474	600449	宁夏建材	43,434	317,936.88	0.06
475	600888	新疆众和	58,211	317,832.06	0.06
476	600488	天药股份	72,664	314,635.12	0.06
477	002489	浙江永强	29,352	305,847.84	0.05
478	601011	宝泰隆	23,399	304,420.99	0.05
479	002503	搜于特	36,558	299,775.60	0.05
480	603077	和邦股份	22,950	298,350.00	0.05
481	600737	中粮屯河	62,096	296,818.88	0.05
482	000935	四川双马	56,349	293,578.29	0.05
483	600683	京投银泰	56,055	278,593.35	0.05

484	600333	长春燃气	40,100	277,091.00	0.05
485	600468	百利电气	27,602	274,915.92	0.05
486	000620	新华联	48,333	271,148.13	0.05
487	002678	珠江钢琴	28,951	270,691.85	0.05
488	601388	怡球资源	24,792	267,505.68	0.05
489	002032	苏泊尔	19,200	262,848.00	0.05
490	000927	一汽夏利	72,395	258,450.15	0.05
491	000861	海印股份	26,844	257,433.96	0.05
492	600618	氯碱化工	33,998	252,605.14	0.05
493	603001	奥康国际	18,223	250,566.25	0.04
494	002612	朗姿股份	12,401	249,012.08	0.04
495	600094	大名城	39,719	247,052.18	0.04
496	600869	远东电缆	29,977	244,312.55	0.04
497	000780	平庄能源	61,383	241,849.02	0.04
498	603555	贵人鸟	18,600	236,778.00	0.04
499	002419	天虹商场	24,190	229,805.00	0.04
500	002662	京威股份	27,250	218,817.50	0.04
501	002705	新宝股份	13,400	200,196.00	0.04
502	002534	杭锅股份	12,085	162,059.85	0.03

### 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

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	300385	雪浪环境	500	12,830.00	0.00

注：上述股票明细为本基金本报告期末持有的积极投资的全部股票。

## 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	002153	石基信息	9,286,773.62	1.53
2	000415	渤海租赁	7,680,266.44	1.26
3	000921	海信科龙	7,673,816.55	1.26
4	000563	陕国投 A	7,201,186.96	1.18

5	002022	科华生物	7,117,348.11	1.17
6	002152	广电运通	7,099,094.54	1.17
7	002273	水晶光电	6,824,065.92	1.12
8	600704	物产中大	6,560,463.70	1.08
9	600765	中航重机	6,529,362.17	1.07
10	600517	置信电气	6,498,780.23	1.07
11	000848	承德露露	6,170,391.26	1.01
12	002064	华峰氨纶	5,843,039.63	0.96
13	002028	思源电气	5,831,409.83	0.96
14	000690	宝新能源	5,822,740.01	0.96
15	600499	科达洁能	5,720,106.26	0.94
16	600269	赣粤高速	5,598,665.40	0.92
17	600563	法拉电子	5,557,772.58	0.91
18	600872	中炬高新	5,485,816.11	0.90
19	600158	中体产业	5,227,095.28	0.86
20	002063	远光软件	5,150,529.22	0.85

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	002153	石基信息	9,162,288.63	1.51
2	600499	科达洁能	8,549,933.66	1.41
3	000921	海信科龙	8,304,202.63	1.37
4	002410	广联达	7,975,768.15	1.31
5	600594	益佰制药	7,273,360.20	1.20
6	002273	水晶光电	7,009,401.45	1.15
7	002008	大族激光	6,885,612.84	1.13
8	002028	思源电气	6,737,039.11	1.11
9	000735	罗牛山	6,682,309.74	1.10
10	600517	置信电气	6,662,974.65	1.10
11	002465	海格通信	6,524,575.12	1.07
12	600158	中体产业	6,521,589.71	1.07
13	002022	科华生物	6,508,340.77	1.07
14	600269	赣粤高速	6,411,979.73	1.05
15	600757	长江传媒	6,321,284.04	1.04



16	000848	承德露露	6,311,726.38	1.04
17	000563	陕国投 A	6,268,002.57	1.03
18	002429	兆驰股份	6,210,623.84	1.02
19	000415	渤海租赁	5,828,177.78	0.96
20	002064	华峰氨纶	5,772,625.09	0.95

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	983,437,328.33
卖出股票收入（成交）总额	1,047,379,903.09

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券之一的恒生电子的发行人恒生电子股份有限公司(以下简称“恒生电子公司”)的控股子公司杭州数米基金销售有限公司(以下简称“数米公司”)收到浙江证监局【2013】13号行政监管措施决定书(以下简称“决定书”)。决定书主要内容为：经查，数米公司自2013年12月9日始通过公司网站等渠道，宣传“数米胜百八”活动，对通过数米公司购买货币市场基金产品的投资者进行收益补贴，宣传资料中存在“最高可享8.8%年化收益”等不当用语，根据《证券投资基金销售管理办法》相关规定，责令数米公司限期改正。

数米公司系恒生电子公司的控股子公司，根据恒生电子公司发布的公告，数米公司将依照监管部门的要求进行整改与报告，上述事项对恒生电子的日常经营、管理、业绩不构成重大影响。

对该股票的投资决策程序的说明：本次行政监管措施对该股票的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数，控制跟踪误差对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置，符合指数基金的管理规定，该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其他证券本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	249,830.58

2	应收证券清算款	971,902.19
3	应收股利	-
4	应收利息	7,184.26
5	应收申购款	29,757.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,258,674.50

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：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。

#### 7.12.6 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
23,053	30,049.31	3,305,335.62	0.48%	689,421,395.33	99.52%

### 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	3.93%
2	王延安	1,280,252.00	2.58%
3	肖菊华	1,000,070.00	2.01%

4	钟莉莉	1,000,060.00	2.01%
5	冷利群	800,024.00	1.61%
6	王军	603,600.00	1.22%
7	韩可新	594,017.00	1.20%
8	计珏	562,135.00	1.13%
9	朱建生	500,115.00	1.01%
10	郭树桂	497,034.00	1.00%

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	305,394.66	0.0441%

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

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 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	761,808,825.91
本报告期基金总申购份额	312,601,842.42
减:本报告期基金总赎回份额	381,683,937.38
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期末基金份额总额	692,726,730.95

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

基金管理人的重大人事变动：报告期内公司原副总经理毕国强因个人职业发展原因提出辞

职，经公司第五届董事会第二十六次会议审议，同意毕国强先生提出的辞职申请，并同意其在办理完工作交接手续后正式离任。毕国强先生于 2014 年 7 月 10 日正式离任。

基金托管人的重大人事变动：本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

### 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	11,048,065,646.95	51.60%	926,788.85	50.87%	-
国信证券	1	689,562,814.62	33.95%	627,782.88	34.46%	-
银河证券	1	293,443,495.39	14.45%	267,148.47	14.66%	-

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
长江证券	179,417.45	100.00%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

### 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	鹏华基金关于旗下部分开放式基金参与邮储银行个人网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 1 月 2 日
2	鹏华基金 2013 年四季度报告	中国证券报、上海证	2014 年 1 月 21 日

		券报、证券时报	
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 1 月 24 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	2014 年 1 月 30 日
5	鹏华基金管理有限公司关于广州银行股份有限公司停止代理销售旗下部分开放式基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 2 月 17 日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 2 月 27 日
7	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 更新的招募说明书摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 3 月 15 日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 3 月 25 日
9	鹏华基金 2013 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 3 月 27 日
10	鹏华基金 2014 年一季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 4 月 22 日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 4 月 26 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 4 月 29 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 4 月 29 日
14	鹏华基金管理有限公司关于新增东莞农村商业银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 5 月 14 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 6 月 6 日
16	鹏华基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况的公告	证券时报	2014 年 6 月 14 日
17	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 6 月 28 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) 2014 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  
2014 年 8 月 26 日