

鹏华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)2015 年半年度报告

2015 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：2015 年 8 月 25 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 2015 年 8 月 20 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 2015 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.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47

§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
§9 开放式基金份额变动	50
§10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	52
§11 备查文件目录	64
11.1 备查文件目录.....	64
11.2 存放地点.....	64
11.3 查阅方式.....	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	鹏华沪深 300 指数 (LOF)
场内简称	鹏华 300
基金主代码	160615
交易代码	160615
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2009 年 4 月 3 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	242,318,854.56 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	2009-05-08

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, 力争将日平均跟踪误差控制在 0.35% 以内, 以实现沪深 300 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, 按照成份股在沪深 300 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, 并辅之以金融衍生产品投资管理等, 使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	沪深 300 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风险、较高收益品种。

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	蒋松云
	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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	269,979,381.33
本期利润	155,433,903.80
加权平均基金份额本期利润	0.4083
本期加权平均净值利润率	27.49%
本期基金份额净值增长率	27.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	159,510,704.62

期末可供分配基金份额利润	0.6583
期末基金资产净值	401,829,559.18
期末基金份额净值	1.658
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	73.76%

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

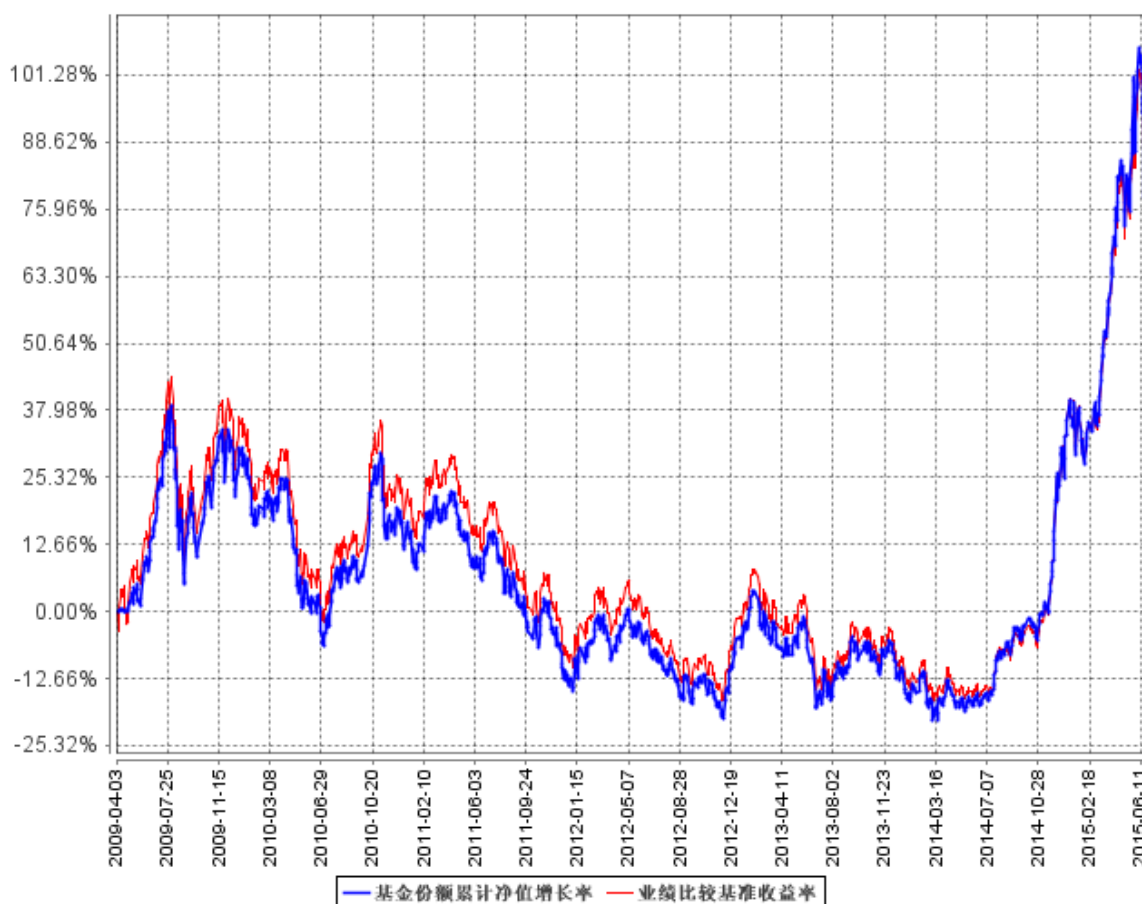
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-7.01%	3.41%	-7.17%	3.32%	0.16%	0.09%
过去三个月	11.50%	2.56%	9.99%	2.48%	1.51%	0.08%
过去六个月	27.83%	2.19%	25.30%	2.15%	2.53%	0.04%
过去一年	106.99%	1.76%	99.71%	1.75%	7.28%	0.01%
过去三年	87.98%	1.45%	77.24%	1.42%	10.74%	0.03%
自基金合同生效起至今	73.76%	1.45%	70.72%	1.46%	3.04%	-0.01%

注：基金业绩比较基准=沪深 300 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、鹏华沪深 300 指数（LOF）基金合同于 2009 年 4 月 3 日生效。

2、按基金合同规定，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，公司管理资产总规模达到 3575.13 亿元，管理 81 只开放式基金、10 只全国社保投资组合。经过近 17 年投资管理基金，在基金投资、

风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王咏辉	本基金基金经理	2014 年 12 月 6 日	-	17	王咏辉先生，国籍英国，英国牛津大学工程和计算机专业硕士，17 年证券基金从业经验。曾担任伦敦摩根大通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

				<p>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，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，2014 年 9 月起兼任鹏华中证 800 地产指数分级</p>
--	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					<p>证券投资基金基金经理，2014年12月起兼任鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理，2015年6月起兼任鹏华创业板指数分级证券投资基金、鹏华中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理，现同时担任量化及衍生品投资部总经理、投资决策委员会成员。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。</p>
--	--	--	--	--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内, 本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 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 股市场在呈现加速上涨的格局, 然后在二季度末由于市场前期上涨过快导致上证指数快速回调到 4277 点左右。本基金秉承指数基金的投资策略, 在报告期内连续遭遇一定比例申购赎回, 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, 同时实现了一定稳定的超越基准的超额收益。

基金投资运作方面, 2015 年 5 月 28 日, 本公司发布了《鹏华基金管理有限公司关于旗下按照指数构成比例投资的基金修订基金合同条款的公告》, 根据该公告, 本基金可以投资关联方发行、承销证券。报告期内, 本基金严格按照基金合同要求, 在指数权重及成份股变动时, 努力降低成本、减少市场冲击, 逐步调整组合至目标结构。

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 1.658 元, 累计净值 1.718 元; 本报告期基金份额净值增长率

为 27.83%，业绩比较基准收益率 25.30%

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“QE”来防范系统性风险的爆发。近期受降息、降准以及地产价格和销售量回升的支持，经济有短期企稳迹象，房地产市场一线价格大幅上涨，而二三线的房价调整仍在继续，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，联储加息预期将升温，从而导致全球资本流动逆转，美元指数走强冲高回落，上游资源内股票呈现反转趋势，但是外部风险值得关注。

在经济“再平衡”的背景下，创新力度不断加强，政策利好不断涌现，A 股市场延续“快速上涨”后短期回调，中长期看 A 股市场仍是一个成长性高的市场，同时需要了解经济转型驱动 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，重点关注估值低和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]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159,510,704.62元, 期末基金份额净值1.658元。

4.7.2 本基金本报告期内未进行利润分配。

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对鹏华沪深 300 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,鹏华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)的管理人——鹏华基金管理有限公司在

鹏华沪深 300 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, 鹏华沪深 300 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沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2015 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: 鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2015 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	22,000,033.23	38,960,495.01
结算备付金		1,056,583.20	1,424,071.42
存出保证金		213,580.28	115,417.38
交易性金融资产	6.4.7.2	376,479,246.77	624,138,406.35
其中: 股票投资		376,479,246.77	624,138,406.35
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		68,869.11	1,591,726.69
应收利息	6.4.7.5	4,106.70	9,042.89
应收股利		-	-
应收申购款		14,322,279.58	3,356,225.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		414,144,698.87	669,595,385.26
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 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		-	1,888,953.09
应付赎回款		10,836,193.87	6,722,213.15
应付管理人报酬		276,449.15	382,940.99
应付托管费		55,289.83	76,588.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	607,542.84	429,059.02
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	539,664.00	390,308.07
负债合计		12,315,139.69	9,890,062.52
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	242,318,854.56	508,588,451.00
未分配利润	6.4.7.10	159,510,704.62	151,116,871.74
所有者权益合计		401,829,559.18	659,705,322.74
负债和所有者权益总计		414,144,698.87	669,595,385.26

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.658 元，基金份额总额 242,318,854.56 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 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
		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		162,162,204.97	-40,029,886.89
1.利息收入		139,242.16	163,237.43
其中：存款利息收入	6.4.7.11	139,221.27	162,810.02
债券利息收入		20.89	427.41
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）		275,860,909.67	-42,874,078.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	273,326,292.46	-48,440,313.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	41,272.51	105,860.23
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	2,493,344.70	5,460,374.99
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-114,545,477.53	2,144,659.41
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	707,530.67	536,294.27
减：二、费用		6,728,301.17	7,099,453.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,107,497.30	2,417,658.26
2. 托管费	6.4.10.2.2	421,499.48	483,531.65
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	3,983,298.21	3,974,776.98
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	216,006.18	223,486.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		155,433,903.80	-47,129,340.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		155,433,903.80	-47,129,340.56

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	508,588,451.00	151,116,871.74	659,705,322.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	155,433,903.80	155,433,903.80
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）	-266,269,596.44	-147,040,070.92	-413,309,667.36
其中：1.基金申购款	308,543,971.84	158,739,323.68	467,283,295.52
2.基金赎回款	-574,813,568.28	-305,779,394.60	-880,592,962.88
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)	242,318,854.56	159,510,704.62	401,829,559.18
项目	上年度可比期间 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)	844,038,231.03	-123,360,359.81	720,677,871.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-47,129,340.56	-47,129,340.56
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)	-177,080,668.49	37,795,708.61	-139,284,959.88
其中：1.基金申购款	391,378,007.19	-72,306,390.90	319,071,616.29
2.基金赎回款	-568,458,675.68	110,102,099.51	-458,356,576.17
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)	666,957,562.54	-132,693,991.76	534,263,570.78

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u> 邓召明 </u>	<u> 高鹏 </u>	<u> 郝文高 </u>
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

鹏华沪深 300 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]41 号文《关于核准鹏华沪深 300 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《鹏华沪深 300 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 1,994,133,345.09 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(2009)第 051 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2009 年 4 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,994,428,997.48 份基金份额,其中认购资金利息折合 295,652.39 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[2009]第 32 号文审核同意,本基金 394,502,086.00 份基金份额于 2009 年 5 月 8 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《鹏华沪深 300 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,主要投资于沪深 300 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沪深 300 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。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华沪深 300 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 2015 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 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会计年度报告相一致的说明

本基金本报告期的会计估计发生变更。本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”),对于交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

除以上会计估计的变更,本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本报告期本基金没有发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

本报告期税项未发生变化。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	22,000,033.23
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	22,000,033.23

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	317,655,253.77	376,479,246.77	58,823,993.00
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	317,655,253.77	376,479,246.77	58,823,993.00

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，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 2015年6月30日
应收活期存款利息	3,592.26
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	427.95
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	86.49
合计	4,106.70

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末，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 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	607,542.84
银行间市场应付交易费用	-
合计	607,542.84

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	23,951.82

预提费用	515,712.18
合计	539,664.00

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	508,588,451.00	508,588,451.00
本期申购	308,543,971.84	308,543,971.84
本期赎回(以“-”号填列)	-574,813,568.28	-574,813,568.28
本期末	242,318,854.56	242,318,854.56

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	47,625,380.92	103,491,490.82	151,116,871.74
本期利润	269,979,381.33	-114,545,477.53	155,433,903.80
本期基金份额交易产生的变动数	-120,336,951.85	-26,703,119.07	-147,040,070.92
其中：基金申购款	129,868,233.70	28,871,089.98	158,739,323.68
基金赎回款	-250,205,185.55	-55,574,209.05	-305,779,394.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	197,267,810.40	-37,757,105.78	159,510,704.62

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	116,363.71
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	15,409.77
其他	7,447.79
合计	139,221.27

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,474,498,996.21
减：卖出股票成本总额	1,201,172,703.75
买卖股票差价收入	273,326,292.46

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	155,293.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	114,000.00
减：应收利息总额	20.89
买卖债券差价收入	41,272.51

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,493,344.70
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,493,344.70

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-114,545,477.53
——股票投资	-114,545,477.53
——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	-114,545,477.53

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	451,636.48
其他	416.42
转换费收入	255,477.77
合计	707,530.67

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	3,983,298.21
银行间市场交易费用	-
合计	3,983,298.21

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	37,191.88
信息披露费	148,767.52
上市年费	29,752.78
银行汇划费用	294.00
合计	216,006.18

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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	1,034,032,440.04	41.11%	2,562,321,820.38	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
国信证券	144,573.40	93.10%	3,489,890.45	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方发生债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行权证交易。

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 2015年1月1日至2015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	923,536.33	41.27%	77,857.11	12.82%
关联方名称	上年度可比期间 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	2,307,674.52	100.00%	634,873.01	100.00%

注：1、佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=买（卖）成交金额×1%-买（卖）经手费-买（卖）证管费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 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,107,497.30
其中：支付销售机构的客	409,007.06	344,407.88

户维护费		
------	--	--

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
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	421,499.48	483,531.65

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	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		2014 年 1 月 1 日至 2014 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	22,000,033.23	116,363.71	27,674,430.16	132,175.22

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销的证券。

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（2015 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的股票，也没有持有因认购新发或增发而流通受限的债券及权证等其他证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
600886	国投电力	2015-06-24	重大事项	14.87	-	-	245,740	2,423,210.84	3,654,153.80	-
000963	华东医药	2015-06-26	重大事项	71.48	2015-08-05	69.20	22,287	1,327,492.91	1,593,074.76	-
601633	长城汽车	2015-06-19	重大事项	42.76	2015-07-13	38.50	33,709	1,666,175.00	1,441,396.84	-
600153	建发股份	2015-06-29	重大事项	17.51	-	-	72,090	734,181.90	1,262,295.90	-
000709	河北钢铁	2015-06-30	重大事项	7.00	2015-08-24	6.30	180,267	721,323.45	1,261,869.00	-
601111	中国国航	2015-06-30	重大事项	15.36	2015-07-29	13.78	62,451	586,233.94	959,247.36	-
002001	新和成	2015-06-30	重大事项	17.09	2015-07-13	18.49	48,915	761,932.49	835,957.35	-
002292	奥飞动漫	2015-05-18	重大事项	37.85	-	-	20,002	357,618.21	757,075.70	-
000839	中信国安	2015-06-29	重大事项	23.57	-	-	12,617	166,997.52	297,382.69	-
000778	新兴铸管	2015-06-15	重大事项	12.96	-	-	20,927	106,808.16	271,213.92	-
601021	春秋航空	2015-06-26	重大事项	126.09	2015-07-21	113.48	1,100	134,979.00	138,699.00	-
601216	内蒙君正	2015-06-29	重大事项	24.07	2015-07-02	24.20	5,746	77,098.84	138,306.22	-
600277	亿利能源	2015-06-01	重大事项	14.62	-	-	8,863	78,919.53	129,577.06	-
002416	爱施德	2015-05-05	重大事项	20.67	2015-07-29	18.60	2,351	33,004.22	48,595.17	-

000024	招商地产	2015-04-03	重大事项	36.51	-	-	93,732	2,415,507.38	3,422,155.32	-
000630	铜陵有色	2015-03-09	重大事项	10.32	-	-	37,876	258,530.69	390,880.32	-
000793	华闻传媒	2015-05-26	重大事项	16.89	-	-	12,976	194,562.17	219,164.64	-
000878	云南铜业	2015-06-08	重大事项	18.53	-	-	69,762	961,933.26	1,292,689.86	-
000917	电广传媒	2015-05-28	重大事项	30.81	-	-	7,706	160,364.14	237,421.86	-
002310	东方园林	2015-05-27	重大事项	28.56	-	-	4,400	89,082.80	125,664.00	-
002353	杰瑞股份	2015-05-27	重大事项	35.04	-	-	30,976	1,127,220.65	1,085,399.04	-
002375	亚厦股份	2015-06-17	重大事项	23.96	2015-7-20	26.29	5,261	70,794.43	126,053.56	-
600395	盘江股份	2015-06-09	重大事项	13.06	2015-08-19	14.00	90,084	1,014,505.45	1,176,497.04	-
600900	长江电力	2015-06-15	重大事项	14.35	-	-	127,245	1,207,499.23	1,825,965.75	-

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，将风险控制可在承受的范围之内。

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 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。（2014 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、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品

种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金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 2015 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	22,000,033.23	-	-	-	22,000,033.23
结算备付金	1,056,583.20	0.00	0.00	0.00	1,056,583.20
存出保证金	213,580.28	0.00	0.00	0.00	213,580.28
交易性金融资产	-	-	-	376,479,246.77	376,479,246.77
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	68,869.11	68,869.11
应收利息	0.00	0.00	0.00	4,106.70	4,106.70
应收股利	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	0.00	14,322,279.58	14,322,279.58

其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
资产总计	23,270,196.71	0.00	0.00	390,874,502.16	414,144,698.87
负债					
短期借款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	10,836,193.87	10,836,193.87
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	276,449.15	276,449.15
应付托管费	0.00	0.00	0.00	55,289.83	55,289.83
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	607,542.84	607,542.84
应交税费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	539,664.00	539,664.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	12,315,139.69	12,315,139.69
利率敏感度缺口	23,270,196.71	0.00	0.00	378,559,362.47	401,829,559.18
上年度末 2014 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	38,960,495.01	0.00	0.00	0.00	38,960,495.01
结算备付金	1,424,071.42	0.00	0.00	0.00	1,424,071.42
存出保证金	115,417.38	0.00	0.00	0.00	115,417.38
交易性金融资产	0.00	0.00	0.00	624,138,406.35	624,138,406.35
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	1,591,726.69	1,591,726.69
应收利息	0.00	0.00	0.00	9,042.89	9,042.89
应收股利	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	0.00	3,356,225.52	3,356,225.52
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
资产总计	40,499,983.81	0.00	0.00	629,095,401.45	669,595,385.26
负债					
短期借款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	1,888,953.09	1,888,953.09
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	6,722,213.15	6,722,213.15
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	382,940.99	382,940.99
应付托管费	0.00	0.00	0.00	76,588.20	76,588.20

应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	429,059.02	429,059.02
应交税费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	390,308.07	390,308.07
负债总计	0.00	0.00	0.00	9,890,062.52	9,890,062.52
利率敏感度缺口	40,499,983.81	0.00	0.00	619,205,338.93	659,705,322.74

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%（2014 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（2014 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 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	376,479,246.77	93.69	624,138,406.35	94.61
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	376,479,246.77	93.69	624,138,406.35	94.61

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（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	18,639,694.61	33,481,100.66
	业绩比较基准下降 5%	-18,639,694.61	-33,481,100.66

注：于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 93.69%（2014 年 12 月 31 日：94.61%）因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2014 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	376,479,246.77	90.91
	其中：股票	376,479,246.77	90.91
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	23,056,616.43	5.57
7	其他各项资产	14,608,835.67	3.53
8	合计	414,144,698.87	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	459,714.96	0.11
B	采矿业	12,571,364.97	3.13
C	制造业	133,053,454.89	33.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,858,024.09	3.95
E	建筑业	13,807,890.30	3.44
F	批发和零售业	11,013,181.48	2.74
G	交通运输、仓储和邮政业	11,702,782.97	2.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,140,297.70	3.27
J	金融业	137,164,067.15	34.13
K	房地产业	19,393,111.36	4.83
L	租赁和商务服务业	2,081,461.68	0.52
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,015,532.03	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	116,684.42	0.03
R	文化、体育和娱乐业	3,570,034.99	0.89
S	综合	306,551.57	0.08
	合计	375,254,154.56	93.39

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	1,176,497.04	0.29
C	制造业	-	-
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	48,595.17	0.01
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	1,225,092.21	0.30

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	601318	中国平安	201,887	16,542,620.78	4.12
2	600030	中信证券	365,501	9,835,631.91	2.45
3	600016	民生银行	921,162	9,156,350.28	2.28
4	002241	歌尔声学	250,118	8,979,236.20	2.23
5	601009	南京银行	370,532	8,448,129.60	2.10
6	600015	华夏银行	549,401	8,356,389.21	2.08
7	601601	中国太保	257,379	7,767,698.22	1.93
8	000001	平安银行	507,558	7,379,893.32	1.84
9	000002	万科A	446,632	6,485,096.64	1.61

10	600036	招商银行	336,832	6,305,495.04	1.57
11	002500	山西证券	324,661	5,873,117.49	1.46
12	601166	兴业银行	324,552	5,598,522.00	1.39
13	600837	海通证券	255,812	5,576,701.60	1.39
14	600519	贵州茅台	16,134	4,156,925.10	1.03
15	601766	中国中车	207,376	3,807,423.36	0.95
16	002415	海康威视	83,394	3,736,051.20	0.93
17	601328	交通银行	452,651	3,729,844.24	0.93
18	600886	国投电力	245,740	3,654,153.80	0.91
19	000333	美的集团	97,491	3,634,464.48	0.90
20	000625	长安汽车	170,965	3,615,909.75	0.90
21	000024	招商地产	93,732	3,422,155.32	0.85
22	600999	招商证券	123,599	3,270,429.54	0.81
23	000651	格力电器	50,803	3,246,311.70	0.81
24	000039	中集集团	100,262	3,238,462.60	0.81
25	600637	百视通	71,509	3,009,098.72	0.75
26	000776	广发证券	129,040	2,922,756.00	0.73
27	002142	宁波银行	137,327	2,904,466.05	0.72
28	000338	潍柴动力	90,198	2,855,668.68	0.71
29	601668	中国建筑	327,791	2,723,943.21	0.68
30	002304	洋河股份	38,550	2,673,828.00	0.67
31	600583	海油工程	158,879	2,646,924.14	0.66
32	600000	浦发银行	153,602	2,605,089.92	0.65
33	600048	保利地产	225,281	2,572,709.02	0.64
34	601618	中国中冶	351,566	2,541,822.18	0.63
35	000768	中航飞机	58,159	2,534,569.22	0.63
36	601390	中国中铁	178,252	2,440,269.88	0.61
37	601988	中国银行	485,708	2,375,112.12	0.59
38	601998	中信银行	307,851	2,373,531.21	0.59
39	600276	恒瑞医药	52,525	2,339,463.50	0.58
40	601169	北京银行	173,780	2,314,749.60	0.58
41	600089	特变电工	155,086	2,296,823.66	0.57
42	601607	上海医药	102,395	2,280,336.65	0.57
43	601628	中国人寿	72,477	2,269,979.64	0.56
44	600340	华夏幸福	74,538	2,269,682.10	0.56
45	002465	海格通信	69,873	2,249,211.87	0.56
46	000729	燕京啤酒	215,475	2,240,940.00	0.56
47	601818	光大银行	416,124	2,230,424.64	0.56
48	601288	农业银行	583,543	2,164,944.53	0.54

49	600150	中国船舶	41,762	2,150,743.00	0.54
50	600027	华电国际	192,690	2,142,712.80	0.53
51	600690	青岛海尔	70,473	2,137,446.09	0.53
52	601006	大秦铁路	150,231	2,109,243.24	0.52
53	002202	金风科技	108,320	2,108,990.40	0.52
54	000063	中兴通讯	86,602	2,061,993.62	0.51
55	600887	伊利股份	104,876	1,982,156.40	0.49
56	600352	浙江龙盛	138,534	1,963,026.78	0.49
57	600795	国电电力	275,543	1,920,534.71	0.48
58	601866	中海集运	198,568	1,886,396.00	0.47
59	601179	中国西电	182,547	1,871,106.75	0.47
60	600900	长江电力	127,245	1,825,965.75	0.45
61	000027	深圳能源	144,992	1,790,651.20	0.45
62	601688	华泰证券	77,315	1,788,295.95	0.45
63	600597	光明乳业	77,651	1,785,973.00	0.44
64	600741	华域汽车	82,812	1,768,036.20	0.44
65	002230	科大讯飞	49,819	1,740,675.86	0.43
66	000402	金融街	123,162	1,740,279.06	0.43
67	601377	兴业证券	126,769	1,735,467.61	0.43
68	000623	吉林敖东	51,203	1,720,420.80	0.43
69	601600	中国铝业	183,817	1,715,012.61	0.43
70	600827	百联股份	80,964	1,684,860.84	0.42
71	601800	中国交建	95,461	1,676,295.16	0.42
72	600315	上海家化	37,350	1,620,990.00	0.40
73	600369	西南证券	82,364	1,618,452.60	0.40
74	000963	华东医药	22,287	1,593,074.76	0.40
75	002051	中工国际	53,348	1,588,703.44	0.40
76	601336	新华保险	25,806	1,575,714.36	0.39
77	600703	三安光电	48,410	1,515,233.00	0.38
78	601088	中国神华	72,292	1,507,288.20	0.38
79	002008	大族激光	51,786	1,487,293.92	0.37
80	600271	航天信息	22,859	1,479,205.89	0.37
81	600372	中航电子	41,867	1,462,414.31	0.36
82	601939	建设银行	203,953	1,454,184.89	0.36
83	601633	长城汽车	33,709	1,441,396.84	0.36
84	600028	中国石化	201,326	1,421,361.56	0.35
85	600362	江西铜业	63,277	1,361,088.27	0.34
86	000876	新希望	69,858	1,355,943.78	0.34
87	600019	宝钢股份	153,571	1,342,210.54	0.33

88	601018	宁波港	150,572	1,331,056.48	0.33
89	600585	海螺水泥	60,831	1,304,824.95	0.32
90	000878	云南铜业	69,762	1,292,689.86	0.32
91	601098	中南传媒	55,659	1,275,147.69	0.32
92	600256	广汇能源	121,563	1,264,255.20	0.31
93	600839	四川长虹	128,362	1,263,082.08	0.31
94	600153	建发股份	72,090	1,262,295.90	0.31
95	000709	河北钢铁	180,267	1,261,869.00	0.31
96	600674	川投能源	100,284	1,254,552.84	0.31
97	002024	苏宁云商	79,877	1,222,118.10	0.30
98	002236	大华股份	37,970	1,212,002.40	0.30
99	002673	西部证券	42,402	1,202,944.74	0.30
100	600109	国金证券	48,580	1,185,352.00	0.29
101	601225	陕西煤业	144,549	1,182,410.82	0.29
102	600115	东方航空	95,683	1,178,814.56	0.29
103	000157	中联重科	143,738	1,165,715.18	0.29
104	601857	中国石油	100,773	1,141,758.09	0.28
105	600011	华能国际	80,254	1,125,963.62	0.28
106	601669	中国电建	99,253	1,125,529.02	0.28
107	600050	中国联通	152,502	1,117,839.66	0.28
108	600031	三一重工	112,907	1,094,068.83	0.27
109	000800	一汽轿车	43,886	1,091,883.68	0.27
110	002353	杰瑞股份	30,976	1,085,399.04	0.27
111	300059	东方财富	17,100	1,078,839.00	0.27
112	600038	中直股份	17,300	1,071,735.00	0.27
113	000060	中金岭南	57,610	1,070,969.90	0.27
114	601929	吉视传媒	68,744	1,039,409.28	0.26
115	002450	康得新	33,829	1,035,167.40	0.26
116	601901	方正证券	85,938	1,021,802.82	0.25
117	601989	中国重工	68,997	1,021,155.60	0.25
118	600588	用友网络	22,217	1,019,315.96	0.25
119	000413	东旭光电	103,720	1,014,381.60	0.25
120	000960	锡业股份	50,105	1,009,615.75	0.25
121	600332	白云山	28,235	972,978.10	0.24
122	000898	鞍钢股份	133,100	971,630.00	0.24
123	601928	凤凰传媒	56,519	966,474.90	0.24
124	600739	辽宁成大	39,495	965,652.75	0.24
125	601111	中国国航	62,451	959,247.36	0.24
126	600518	康美药业	54,002	957,455.46	0.24

127	000425	徐工机械	71,380	947,212.60	0.24
128	600252	中恒集团	40,840	939,320.00	0.23
129	000999	华润三九	30,428	924,706.92	0.23
130	002422	科伦药业	22,825	913,913.00	0.23
131	600010	包钢股份	173,839	902,224.41	0.22
132	601888	中国国旅	13,467	892,862.10	0.22
133	600221	海南航空	135,607	866,528.73	0.22
134	002001	新和成	48,915	835,957.35	0.21
135	601258	庞大集团	151,448	826,906.08	0.21
136	600570	恒生电子	7,300	817,965.00	0.20
137	000568	泸州老窖	24,840	810,032.40	0.20
138	600009	上海机场	25,007	792,721.90	0.20
139	600998	九州通	35,062	783,986.32	0.20
140	000686	东北证券	39,563	770,291.61	0.19
141	002292	奥飞动漫	20,002	757,075.70	0.19
142	601899	紫金矿业	147,327	754,314.24	0.19
143	601555	东吴证券	36,828	753,869.16	0.19
144	000423	东阿阿胶	13,757	749,756.50	0.19
145	002252	上海莱士	11,199	732,862.56	0.18
146	601788	光大证券	26,400	711,480.00	0.18
147	600196	复星医药	24,491	708,769.54	0.18
148	600383	金地集团	55,959	707,881.35	0.18
149	600104	上汽集团	30,907	698,498.20	0.17
150	600029	南方航空	47,454	689,981.16	0.17
151	601808	中海油服	24,678	689,503.32	0.17
152	600398	海澜之家	37,834	685,930.42	0.17
153	000166	申万宏源	41,334	671,677.50	0.17
154	600415	小商品城	43,730	668,194.40	0.17
155	600018	上港集团	80,882	639,776.62	0.16
156	000559	万向钱潮	28,620	625,633.20	0.16
157	600649	城投控股	66,323	620,120.05	0.15
158	000725	京东方 A	115,805	601,027.95	0.15
159	600005	武钢股份	85,200	598,956.00	0.15
160	600060	海信电器	24,267	596,725.53	0.15
161	000895	双汇发展	27,968	596,557.44	0.15
162	600663	陆家嘴	11,927	593,248.98	0.15
163	600177	雅戈尔	32,303	589,852.78	0.15
164	600100	同方股份	27,027	567,296.73	0.14
165	000858	五粮液	17,780	563,626.00	0.14

166	600642	申能股份	55,647	557,026.47	0.14
167	600118	中国卫星	9,396	535,196.16	0.13
168	000728	国元证券	14,039	533,201.22	0.13
169	603288	海天味业	16,473	526,147.62	0.13
170	600705	中航资本	20,952	485,038.80	0.12
171	601333	广深铁路	57,236	470,479.92	0.12
172	002399	海普瑞	13,641	463,657.59	0.12
173	300104	乐视网	8,700	450,312.00	0.11
174	601186	中国铁建	28,592	446,892.96	0.11
175	000100	TCL 集团	78,833	445,406.45	0.11
176	600068	葛洲坝	38,082	445,178.58	0.11
177	000069	华侨城 A	33,699	437,413.02	0.11
178	000783	长江证券	30,965	431,961.75	0.11
179	600208	新湖中宝	55,597	429,208.84	0.11
180	000538	云南白药	4,920	424,448.40	0.11
181	600373	中文传媒	17,504	419,395.84	0.10
182	601727	上海电气	27,458	409,947.94	0.10
183	000630	铜陵有色	37,876	390,880.32	0.10
184	000046	泛海控股	25,700	376,505.00	0.09
185	600111	北方稀土	20,203	366,482.42	0.09
186	601991	大唐发电	45,300	361,494.00	0.09
187	601919	中国远洋	28,300	353,184.00	0.09
188	600688	上海石化	32,912	353,145.76	0.09
189	300017	网宿科技	7,414	344,157.88	0.09
190	300070	碧水源	6,900	336,651.00	0.08
191	000503	海虹控股	6,779	332,171.00	0.08
192	300024	机器人	4,200	324,492.00	0.08
193	600804	鹏博士	10,509	313,798.74	0.08
194	300027	华谊兄弟	8,100	308,934.00	0.08
195	601118	海南橡胶	31,526	308,324.28	0.08
196	600535	天士力	6,039	300,500.64	0.07
197	000839	中信国安	12,617	297,382.69	0.07
198	601099	太平洋	23,000	297,160.00	0.07
199	000883	湖北能源	33,705	293,907.60	0.07
200	600893	中航动力	5,503	292,484.45	0.07
201	601106	中国一重	24,100	291,851.00	0.07
202	600958	东方证券	9,900	283,338.00	0.07
203	002736	国信证券	11,200	281,008.00	0.07
204	600406	国电南瑞	13,537	280,080.53	0.07

205	000778	新兴铸管	20,927	271,213.92	0.07
206	002294	信立泰	9,118	260,774.80	0.06
207	600066	宇通客车	12,275	252,251.25	0.06
208	600023	浙能电力	25,165	249,636.80	0.06
209	600309	万华化学	10,281	248,594.58	0.06
210	002594	比亚迪	4,473	247,043.79	0.06
211	000826	桑德环境	6,209	241,468.01	0.06
212	601992	金隅股份	19,901	237,816.95	0.06
213	000917	电广传媒	7,706	237,421.86	0.06
214	002081	金螳螂	8,311	234,287.09	0.06
215	600873	梅花生物	22,441	234,284.04	0.06
216	600085	同仁堂	6,519	234,097.29	0.06
217	600875	东方电气	11,105	227,319.35	0.06
218	002153	石基信息	1,735	225,532.65	0.06
219	601933	永辉超市	19,108	221,461.72	0.06
220	600863	内蒙华电	26,799	219,215.82	0.05
221	000793	华闻传媒	12,976	219,164.64	0.05
222	000750	国海证券	12,919	217,039.20	0.05
223	000629	攀钢钒钛	40,455	216,838.80	0.05
224	300124	汇川技术	4,500	216,000.00	0.05
225	600157	永泰能源	31,091	213,906.08	0.05
226	002065	东华软件	7,198	206,942.50	0.05
227	002475	立讯精密	6,084	205,700.04	0.05
228	002038	双鹭药业	3,616	204,846.40	0.05
229	300058	蓝色光标	12,640	199,838.40	0.05
230	002456	欧菲光	5,828	196,636.72	0.05
231	000009	中国宝安	11,883	193,811.73	0.05
232	601168	西部矿业	17,707	193,360.44	0.05
233	601898	中煤能源	16,931	193,352.02	0.05
234	002470	金正大	8,848	192,090.08	0.05
235	600660	福耀玻璃	13,265	189,424.20	0.05
236	002385	大北农	13,844	187,170.88	0.05
237	300003	乐普医疗	4,600	186,622.00	0.05
238	002007	华兰生物	4,039	178,887.31	0.04
239	601117	中国化学	18,264	178,621.92	0.04
240	600489	中金黄金	13,800	177,606.00	0.04
241	002146	荣盛发展	14,098	176,225.00	0.04
242	600717	天津港	11,600	173,884.00	0.04
243	600718	东软集团	7,955	172,862.15	0.04

244	600648	外高桥	4,917	172,488.36	0.04
245	000581	威孚高科	5,561	172,335.39	0.04
246	002129	中环股份	8,695	172,074.05	0.04
247	300002	神州泰岳	11,200	170,688.00	0.04
248	000792	盐湖股份	6,004	170,393.52	0.04
249	600547	山东黄金	6,734	166,329.80	0.04
250	000970	中科三环	8,037	165,642.57	0.04
251	600867	通化东宝	7,442	163,203.06	0.04
252	000061	农产品	7,991	163,016.40	0.04
253	000598	兴蓉环境	16,611	158,967.27	0.04
254	002344	海宁皮城	8,026	157,550.38	0.04
255	600170	上海建工	16,485	154,629.30	0.04
256	600600	青岛啤酒	3,253	151,557.27	0.04
257	600108	亚盛集团	14,613	151,390.68	0.04
258	002410	广联达	6,435	150,579.00	0.04
259	000825	太钢不锈	21,100	150,021.00	0.04
260	000400	许继电气	5,751	144,695.16	0.04
261	000831	五矿稀土	5,631	144,040.98	0.04
262	000712	锦龙股份	4,100	143,910.00	0.04
263	000738	中航动控	4,200	139,272.00	0.03
264	601021	春秋航空	1,100	138,699.00	0.03
265	601216	内蒙君正	5,746	138,306.22	0.03
266	000983	西山煤电	14,539	137,829.72	0.03
267	600497	驰宏锌锗	9,313	135,876.67	0.03
268	600166	福田汽车	15,383	135,831.89	0.03
269	600316	洪都航空	3,928	135,830.24	0.03
270	603000	人民网	2,594	135,225.22	0.03
271	600008	首创股份	9,061	130,025.35	0.03
272	600277	亿利能源	8,863	129,577.06	0.03
273	002375	亚厦股份	5,261	126,053.56	0.03
274	002310	东方园林	4,400	125,664.00	0.03
275	300015	爱尔眼科	3,617	116,684.42	0.03
276	600578	京能电力	13,000	116,090.00	0.03
277	600516	方大炭素	9,688	115,384.08	0.03
278	600348	阳泉煤业	11,102	113,795.50	0.03
279	600317	营口港	17,900	112,770.00	0.03
280	600783	鲁信创投	3,008	112,739.84	0.03
281	600633	浙报传媒	5,583	109,426.80	0.03
282	601699	潞安环能	11,265	108,932.55	0.03

283	601958	金铂股份	9,215	108,552.70	0.03
284	300146	汤臣倍健	2,700	106,056.00	0.03
285	300251	光线传媒	4,120	102,588.00	0.03
286	600549	厦门钨业	4,009	101,267.34	0.03
287	300133	华策影视	3,600	97,200.00	0.02
288	002570	贝因美	4,807	93,303.87	0.02
289	600485	信威集团	2,000	87,780.00	0.02
290	000937	冀中能源	9,963	79,903.26	0.02
291	000156	华数传媒	2,004	71,703.12	0.02
292	600809	山西汾酒	2,479	70,006.96	0.02
293	601158	重庆水务	5,319	57,126.06	0.01
294	002653	海思科	2,100	56,700.00	0.01
295	600188	兖州煤业	3,514	48,317.50	0.01
296	601231	环旭电子	2,130	36,231.30	0.01
297	601969	海南矿业	1,900	34,637.00	0.01
298	603993	洛阳钼业	2,776	34,311.36	0.01

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	600395	盘江股份	90,084	1,176,497.04	0.29
2	002416	爱施德	2,351	48,595.17	0.01

注：上述股票明细为本基金本报告期末持有的全部积极投资的股票。

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	600030	中信证券	27,078,432.88	4.10
2	000001	平安银行	24,721,099.50	3.75
3	601318	中国平安	22,585,899.17	3.42
4	600015	华夏银行	21,317,921.84	3.23
5	002241	歌尔声学	21,243,802.49	3.22
6	600588	用友网络	20,017,259.30	3.03

7	002500	山西证券	17,590,522.31	2.67
8	600048	保利地产	17,532,238.20	2.66
9	600690	青岛海尔	15,190,309.60	2.30
10	601601	中国太保	14,957,913.60	2.27
11	600016	民生银行	14,945,225.36	2.27
12	002142	宁波银行	14,799,672.97	2.24
13	601555	东吴证券	14,226,552.69	2.16
14	000425	徐工机械	12,923,826.94	1.96
15	000002	万科A	12,867,726.71	1.95
16	601009	南京银行	12,729,205.72	1.93
17	000338	潍柴动力	12,204,205.74	1.85
18	601766	中国中车	11,074,636.16	1.68
19	600036	招商银行	10,839,885.76	1.64
20	600109	国金证券	10,441,198.53	1.58

注：买入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。

7.4.2 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	601318	中国平安	34,923,062.72	5.29
2	600030	中信证券	33,681,770.44	5.11
3	600016	民生银行	26,818,514.15	4.07
4	000001	平安银行	26,060,278.34	3.95
5	600036	招商银行	24,660,257.03	3.74
6	600588	用友网络	22,347,877.25	3.39
7	600048	保利地产	20,809,079.88	3.15
8	600000	浦发银行	20,529,086.08	3.11
9	600015	华夏银行	20,387,981.83	3.09
10	601166	兴业银行	17,366,175.80	2.63
11	601555	东吴证券	17,012,092.25	2.58
12	000002	万科A	16,907,265.68	2.56
13	600690	青岛海尔	16,844,820.67	2.55
14	002500	山西证券	16,087,785.38	2.44
15	601766	中国中车	15,992,849.76	2.42
16	002241	歌尔声学	15,952,049.75	2.42
17	601601	中国太保	14,263,701.18	2.16

18	600837	海通证券	14,085,410.75	2.14
19	600109	国金证券	13,464,438.65	2.04
20	002142	宁波银行	13,259,446.52	2.01

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

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	1,068,059,021.70
卖出股票收入（成交）总额	1,474,498,996.21

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

注：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

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：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

根据中国证监会[2014]103 号文，本基金投资的前十名证券之一的中国平安的发行主体中国平安保险(集团)股份有限公司(简称“中国平安”)的控股子公司平安证券有限责任公司(简称“平安证券”)于 2014 年 12 月 08 日收到《中国证监会行政处罚决定书》，称平安证券在深圳海联讯科技股份有限公司(简称“海联讯”)首次公开发行股票并在创业板上市项目中作为海联讯的保荐机构和主承销商，因未勤勉尽责，未能发现海联讯在会计期末虚构收回应收账款，同时在相关会计期间虚增营业收入的事实，致使其所出具的保荐书中关于海联讯应收账款项目的财务数据和财务指标的陈述、海联讯最近三年财务会计文件无虚假记载的陈述、海联讯符合发行上市条件的结论意见存在虚假记载，中国证监会决定对平安证券给予警告，没收保荐业务收入 400 万元，没收承销股票违法所得 2,867 万元，并处以 440 万元罚款。

对该股票的投资决策程序的说明：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 ETF 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。

组合投资的前十名证券之一的中信证券的发行主体中信证券股份有限公司在证监会 2014 年四季度两融检查时，存在违规为到期融资融券合约展期问题，受过处理仍未改正，且涉及客户数量较多，对中信证券采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。

对该股票的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该股票，认为中信证券作为国内资产规模领先的大型券商，未来将受益于券商行业的大发展。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和控制跟踪误差，对该证券的投资按照指数成份股权重进行配置，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	213,580.28
2	应收证券清算款	68,869.11
3	应收股利	-
4	应收利息	4,106.70
5	应收申购款	14,322,279.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,608,835.67

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

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	002416	爱施德	48,595.17	0.01	重大事项停牌
2	600395	盘江股份	1,176,497.04	0.29	重大事项停牌

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
12,512	19,366.92	10,439,641.79	4.31%	231,879,212.77	95.69%

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	宁波航发贸易有限公司	869,380.00	7.47%
2	徐志林	605,300.00	5.20%
3	马贵璋	500,000.00	4.29%
4	赵凡	400,400.00	3.44%
5	潮州市恒信医药有限公司	345,500.00	2.97%
6	梁玛丽	305,039.00	2.62%
7	唐万军	300,000.00	2.58%
8	赖交雄	211,799.00	1.82%
9	赫清华	200,006.00	1.72%
10	李宏英	198,013.00	1.70%

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	113,464.38	0.0468%

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：（1）本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人本报告期末未持有本基金份额。
（2）本基金的基金经理本报告期末未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 4 月 3 日）基金份额总额	1,994,428,997.48
本报告期期初基金份额总额	508,588,451.00
本报告期基金总申购份额	308,543,971.84
减：本报告期基金总赎回份额	574,813,568.28
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	242,318,854.56

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动：

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

报告期内经公司股东会审议通过，公司聘任陈冰女士担任公司监事，并自陈冰女士担任公司监事之日起，李国阳先生不再担任公司监事。陈冰女士任职日期自 2015 年 6 月 2 日起。

10.2.2 报告期内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	
西南证券	1	11,344,148,183.81	53.44%	1,193,042.71	53.31%	-
国信证券	1	21,034,032,440.04	41.11%	923,536.33	41.27%	-
兴业证券	1	136,970,311.18	5.45%	121,205.69	5.42%	本报告期新增
中金公司	1	-	-	-	-	本报告期新增

注：交易单元选择的标准和程序

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

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2、选择交易单元的程序：

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

易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
西南证券	10,720.00	6.90%	-	-	-	-
国信证券	144,573.40	93.10%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于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》	2015年1月6日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年1月7日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年1月7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》	2015年1月14日
5	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》	2015年1月21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》	2015年1月21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》	2015年1月21日
8	2014年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015年1月22日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《上	2015年2月4日

	基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	海证券报》、《证券时报》	
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 7 日
11	基金高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 9 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》	2015 年 2 月 12 日
13	鹏华基金管理有限公司关于增加天风证券股份有限公司为我司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》	2015 年 2 月 13 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 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》	2015 年 2 月 14 日
16	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》	2015 年 2 月 17 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》	2015 年 2 月 17 日
18	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》	2015 年 2 月 17 日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 25 日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 2 月 27 日
21	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》	2015 年 3 月 3 日
22	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》	2015 年 3 月 3 日
23	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 3 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》	2015 年 3 月 5 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》	2015 年 3 月 6 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》	2015 年 3 月 11 日
27	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》	2015 年 3 月 14 日
28	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》	2015 年 3 月 19 日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 21 日
30	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 21 日
31	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 21 日
32	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》	2015 年 3 月 24 日
33	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》	2015 年 3 月 24 日
34	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》	2015 年 3 月 25 日
35	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》	2015 年 3 月 25 日
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 25 日
37	2014 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 26 日
38	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 27 日

	变更的提示性公告	报》	
39	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 27 日
40	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 3 月 31 日
41	鹏华基金管理限公司关于参与中国工商银行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》	2015 年 4 月 1 日
42	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》	2015 年 4 月 1 日
43	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》	2015 年 4 月 2 日
44	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》	2015 年 4 月 2 日
45	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》	2015 年 4 月 3 日
46	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 3 日
47	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 4 日
48	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》	2015 年 4 月 4 日
49	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 7 日
50	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 7 日
51	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》	2015 年 4 月 9 日
52	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 13 日
53	鹏华基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《上	2015 年 4 月 13 日

	基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	海证券报》、《证券时报》	
54	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》	2015 年 4 月 14 日
55	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》	2015 年 4 月 15 日
56	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 16 日
57	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 18 日
58	2015 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 21 日
59	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》	2015 年 4 月 23 日
60	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》	2015 年 4 月 23 日
61	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》	2015 年 4 月 23 日
62	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 4 月 24 日
63	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》	2015 年 4 月 28 日
64	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》	2015 年 4 月 28 日
65	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》	2015 年 5 月 7 日
66	鹏华基金管理有限公司关于增加中国国际金融有限公司为我司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》	2015 年 5 月 8 日
67	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》	2015 年 5 月 8 日

68	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》	2015 年 5 月 9 日
69	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》	2015 年 5 月 12 日
70	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》	2015 年 5 月 12 日
71	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》	2015 年 5 月 12 日
72	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》	2015 年 5 月 12 日
73	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》	2015 年 5 月 13 日
74	鹏华沪深 300 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》	2015 年 5 月 15 日
75	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》	2015 年 5 月 15 日
76	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》	2015 年 5 月 16 日
77	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》	2015 年 5 月 19 日
78	鹏华基金管理有限公司关于增加中信建投期货有限公司为我司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》	2015 年 5 月 19 日
79	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》	2015 年 5 月 21 日
80	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》	2015 年 5 月 22 日
81	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》	2015 年 5 月 22 日
82	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》	2015 年 5 月 22 日

	变更的提示性公告	报》	
83	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》	2015 年 5 月 22 日
84	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》	2015 年 5 月 22 日
85	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》	2015 年 5 月 22 日
86	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》	2015 年 5 月 22 日
87	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》	2015 年 5 月 22 日
88	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》	2015 年 5 月 22 日
89	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》	2015 年 5 月 23 日
90	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》	2015 年 5 月 26 日
91	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》	2015 年 5 月 26 日
92	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》	2015 年 5 月 26 日
93	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》	2015 年 5 月 26 日
94	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》	2015 年 5 月 26 日
95	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》	2015 年 5 月 27 日
96	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》	2015 年 5 月 27 日
97	鹏华基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《上	2015 年 5 月 27 日

	基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	海证券报》、《证券时报》	
98	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》	2015 年 5 月 27 日
99	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》	2015 年 5 月 27 日
100	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》	2015 年 5 月 27 日
101	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》	2015 年 5 月 28 日
102	鹏华基金管理有限公司关于旗下按照指数构成比例投资的基金修订基金合同条款的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 5 月 28 日
103	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》	2015 年 5 月 29 日
104	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》	2015 年 5 月 29 日
105	鹏华基金关于旗下部分基金参与中国农业银行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》	2015 年 5 月 30 日
106	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》	2015 年 6 月 2 日
107	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》	2015 年 6 月 2 日
108	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》	2015 年 6 月 3 日
109	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》	2015 年 6 月 3 日
110	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》	2015 年 6 月 3 日
111	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》	2015 年 6 月 3 日

112	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》	2015 年 6 月 3 日
113	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》	2015 年 6 月 6 日
114	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》	2015 年 6 月 9 日
115	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》	2015 年 6 月 9 日
116	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》	2015 年 6 月 11 日
117	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与华鑫证券自助式交易系统投资费率优惠活动公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015 年 6 月 11 日
118	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与国都证券网上交易系统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》	2015 年 6 月 11 日
119	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与平安证券网上交易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》	2015 年 6 月 12 日
120	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》	2015 年 6 月 12 日
121	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》	2015 年 6 月 13 日
122	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》	2015 年 6 月 13 日
123	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》	2015 年 6 月 16 日
124	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》	2015 年 6 月 17 日
125	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》	2015 年 6 月 17 日

126	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》	2015 年 6 月 18 日
127	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》	2015 年 6 月 19 日
128	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》	2015 年 6 月 19 日
129	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》	2015 年 6 月 19 日
130	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》	2015 年 6 月 19 日
131	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》	2015 年 6 月 19 日
132	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》	2015 年 6 月 19 日
133	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》	2015 年 6 月 20 日
134	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》	2015 年 6 月 20 日
135	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》	2015 年 6 月 20 日
136	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》	2015 年 6 月 20 日
137	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》	2015 年 6 月 20 日
138	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》	2015 年 6 月 20 日
139	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》	2015 年 6 月 20 日
140	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》	2015 年 6 月 20 日

	变更的提示性公告	报》	
141	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》	2015 年 6 月 20 日
142	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》	2015 年 6 月 20 日
143	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》	2015 年 6 月 20 日
144	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》	2015 年 6 月 24 日
145	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》	2015 年 6 月 26 日
146	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》	2015 年 6 月 27 日
147	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》	2015 年 6 月 27 日
148	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》	2015 年 6 月 27 日
149	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》	2015 年 6 月 27 日
150	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》	2015 年 6 月 27 日
151	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》	2015 年 6 月 27 日
152	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》	2015 年 6 月 27 日
153	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》	2015 年 6 月 27 日
154	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》	2015 年 6 月 27 日
155	鹏华基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《上	2015 年 6 月 27 日

	基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	海证券报》、《证券时报》	
156	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》	2015 年 6 月 30 日
157	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》	2015 年 6 月 30 日
158	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》	2015 年 6 月 30 日
159	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》	2015 年 6 月 30 日
160	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》	2015 年 6 月 30 日
161	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》	2015 年 6 月 30 日
162	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》	2015 年 6 月 30 日
163	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》	2015 年 6 月 30 日
164	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》	2015 年 6 月 30 日
165	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》	2015 年 6 月 30 日
166	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》	2015 年 6 月 30 日
167	鹏华基金旗下部分基金参与交通银行网上银行、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》	2015 年 6 月 30 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一)《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》;
- (二)《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》;
- (三)《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2015 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
2015 年 8 月 25 日