

# 鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 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.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
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
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.....	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.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
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 关联方名称</b> .....	<b>23</b>
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	33
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
8.3 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.....	35
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
8.6 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.....	51
8.7 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.....	51
8.8 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.....	51
8.9 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.....	51
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52

8.12 投资组合报告附注.....	52
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>53</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	53
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
9.4 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.....	54
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>54</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	54
11.2 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.....	54
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
11.4 基金投资策略的改变.....	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
11.8 其他重大事件.....	56
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## § 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	249,527,373.78 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	洪渊
	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	易会满

## 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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-25,771,911.75
本期利润	-61,722,861.99
加权平均基金份额本期利润	-0.2422
本期加权平均净值利润率	-20.38%
本期基金份额净值增长率	-18.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	55,086,918.95
期末可供分配基金份额利润	0.2208
期末基金资产净值	304,614,292.73
期末基金份额净值	1.221
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2016年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	22.10%

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

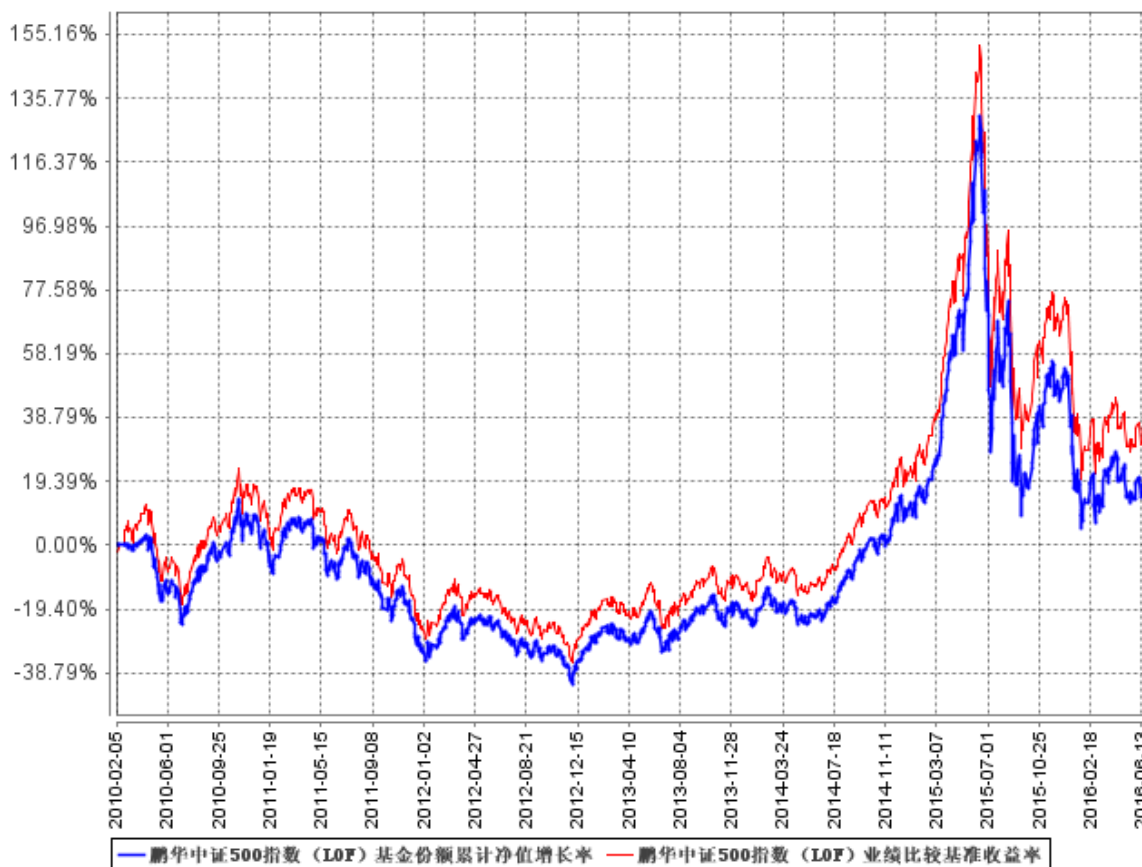
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.13%	1.40%	2.83%	1.47%	0.30%	-0.07%
过去三个月	-1.05%	1.58%	-0.45%	1.57%	-0.60%	0.01%
过去六个月	-18.27%	2.48%	-18.56%	2.43%	0.29%	0.05%
过去一年	-32.17%	3.01%	-29.56%	2.77%	-2.61%	0.24%
过去三年	79.56%	2.15%	84.99%	2.03%	-5.43%	0.12%
自基金合同生效起至今	22.10%	1.84%	38.77%	1.78%	-16.67%	0.06%

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

鹏华中证500指数（LOF）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 2016 年 6 月，公司管理资产总规模达到 3609.67 亿元，管理 99 只公募基金、10 只全国社保投资组合。经过近 18 年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。



#### 4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王咏辉	本基金基金经理	2013 年 12 月 27 日	-	18	王咏辉先生, 国籍英国, 工程和计算机专业硕士, 18 年证券基金从业经验。曾担任伦敦摩根大通 (JPMorgan) 投资基金管理公司高级分析师, 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 (BarclaysCapital) 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及泰达宏利中证财富大盘指数基金、泰达宏利全球新格局 QDII 基金、泰达中证 500 基金基金经理等职; 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 (LOF) 基金基金经理, 2014 年 9 月起兼任鹏华地产分级基金基金经理, 2014 年 12 月起兼任鹏华沪深 300 指数 (LOF) 基金基金经理, 2015 年 6 月起兼任鹏华创业板分级基金、鹏华互联网分级基金基金经理, 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。

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

在本报告期内, 基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益, 严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的规定。

### 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

2016 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 2016 年一季度呈现先下跌然后的逐步见底, 然后二季度呈现逐步反弹的格局, 在 2016 年初的熔断影响下大幅下跌到最近几年的新低 2628 点, 在二季度逐步反弹至 3000 点附近。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 0.29% 的超额收益。

#### 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 1.221 元, 累计净值 1.221 元; 本报告期基金份额净值增长率为 -18.27%, 业绩比较基准收益率 -18.56%。

### 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, 通过有序的市场化改革释放增长新动力, 定向“QE”来防范系统性风险的爆发。未来受降息、降准以及地产价格和销售量回升的支持, 经济预期有短期企稳的可能性, 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, 联储加息节奏放缓, 从而导致全球资本流动逆转, 美元指数冲高回落, 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 股市场在 2015 年“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，现在建议投资者从中长期投资的角度来配置成长股中的低估值的优质资产，重点关注成长性好的低估值公司，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

##### 1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### (1) 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

###### (2) 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

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

##### 3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

##### 4、本公司现没有进行任何定价服务的签约。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末,本基金期末可供分配利润为 55,086,918.95 元,期末基金份额净值 1.221 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,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) 2016 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:2016 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	15,574,785.63	24,436,635.67
结算备付金		726,011.32	278,250.73
存出保证金		45,136.23	117,159.81
交易性金融资产	6.4.7.2	289,514,852.11	333,968,251.07
其中: 股票投资		289,304,936.11	333,968,251.07
基金投资		-	-
债券投资		209,916.00	-
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		297,114.50	-
应收利息	6.4.7.5	3,594.55	3,936.36
应收股利		-	-
应收申购款		98,795.32	95,732.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		306,260,289.66	358,899,966.26
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 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		-	1,065.72
应付赎回款		734,235.54	516,140.14
应付管理人报酬		183,411.86	232,221.33
应付托管费		36,682.37	46,444.27
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	313,978.77	527,980.21
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	377,688.39	483,038.93
负债合计		1,645,996.93	1,806,890.60
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	249,527,373.78	239,018,594.54
未分配利润	6.4.7.10	55,086,918.95	118,074,481.12
所有者权益合计		304,614,292.73	357,093,075.66

负债和所有者权益总计		306,260,289.66	358,899,966.26
------------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.221 元，基金份额总额 249,527,373.78 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-59,336,355.98	301,944,601.93
1.利息收入		75,584.13	142,201.38
其中：存款利息收入	6.4.7.11	75,475.09	142,201.38
债券利息收入		109.04	-
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）		-23,573,111.71	265,998,777.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-25,348,330.52	263,985,513.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	13,317.35	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,761,901.46	2,013,263.31
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-35,950,950.24	35,063,749.11
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	112,121.84	739,874.35
<b>减：二、费用</b>		2,386,506.01	6,425,026.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,130,250.99	2,210,237.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	226,050.20	442,047.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	725,468.74	3,458,168.79
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	304,736.08	314,572.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-61,722,861.99	295,519,575.81
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号</b>		-61,722,861.99	295,519,575.81

填列)			
-----	--	--	--

### 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	239,018,594.54	118,074,481.12	357,093,075.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-61,722,861.99	-61,722,861.99
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）	10,508,779.24	-1,264,700.18	9,244,079.06
其中：1.基金申购款	90,564,061.57	15,685,094.90	106,249,156.47
2.基金赎回款	-80,055,282.33	-16,949,795.08	-97,005,077.41
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）	249,527,373.78	55,086,918.95	304,614,292.73
项目	上年度可比期间 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）	605,607,372.08	60,282,389.41	665,889,761.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	295,519,575.81	295,519,575.81
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）	-361,618,571.23	-160,534,202.43	-522,152,773.66
其中：1.基金申购款	250,916,488.75	157,052,268.52	407,968,757.27
2.基金赎回款	-612,535,059.98	-317,586,470.95	-930,121,530.93

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)	243,988,800.85	195,267,762.79	439,256,563.64

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

鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]第 1374 号《关于核准鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,629,831,732.31 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2009)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,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。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 X95%+银行同业存款利率 X5%。



## 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 2016 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》[适用于 CEF]/财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》[适用于 OEF]、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前, 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起, 金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税, 对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%

的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	15,574,785.63
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	15,574,785.63

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	291,167,586.03	289,304,936.11	-1,862,649.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	209,916.00	29,616.00
	银行间市场	-	-
	合计	209,916.00	29,616.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	291,347,886.03	289,514,852.11	-1,833,033.92

### 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 2016年6月30日
应收活期存款利息	3,189.46
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	294.03
应收债券利息	92.79
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	18.27
合计	3,594.55

### 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 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	313,978.77
银行间市场应付交易费用	-
合计	313,978.77

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,313.31
预提费用	325,375.08
指数使用费	50,000.00
合计	377,688.39

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	239,018,594.54	239,018,594.54
本期申购	90,564,061.57	90,564,061.57
本期赎回(以“-”号填列)	-80,055,282.33	-80,055,282.33
本期末	249,527,373.78	249,527,373.78

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	194,312,766.14	-76,238,285.02	118,074,481.12
本期利润	-25,771,911.75	-35,950,950.24	-61,722,861.99
本期基金份额交易产生的变动数	8,956,784.30	-10,221,484.48	-1,264,700.18
其中：基金申购款	71,816,204.41	-56,131,109.51	15,685,094.90
基金赎回款	-62,859,420.11	45,909,625.03	-16,949,795.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	177,497,638.69	-122,410,719.74	55,086,918.95

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	70,871.25
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	4,017.87
其他	585.97

合计	75,475.09
----	-----------

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
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	234,958,581.44
减：卖出股票成本总额	260,306,911.96
买卖股票差价收入	-25,348,330.52

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	145,333.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	132,000.00
减：应收利息总额	16.25
买卖债券差价收入	13,317.35

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,761,901.46

基金投资产生的股利收益	-
合计	1,761,901.46

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-35,950,950.24
——股票投资	-35,980,566.24
——债券投资	29,616.00
——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	-35,950,950.24

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	98,878.59
转换费收入	13,243.25
合计	112,121.84

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	725,468.74
银行间市场交易费用	-
合计	725,468.74

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

审计费用	25,359.88
信息披露费	149,179.94
上市年费	29,835.26
指数使用费	100,000.00
银行汇划费用	361.00
合计	304,736.08

#### 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 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	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	228,724,688.99	47.11%	949,679,858.13	GpMMZBQCJJDLSN

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	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	14,593.60	10.04%	-	-

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国信证券	213,016.07	47.61%	158,622.05	50.52%
关联方名称	上年度可比期间 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	864,587.49	45.51%	128,249.85	24.37%

注：（1）佣金的计算公式

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

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

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
----	--	---



当期发生的基金应支付的管理费	1,130,250.99	2,210,237.45
其中:支付销售机构的客户维护费	272,789.47	500,866.00

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 $\times$ 0.75% $\div$ 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
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	226,050.20	442,047.52

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 $\times$ 0.15% $\div$ 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注:无。

#### 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	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

工商银行	15,574,785.63	70,871.25	33,910,550.56	124,022.31
------	---------------	-----------	---------------	------------

#### 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

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	2,410	31,281.80	31,281.80	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127003	海印转债	2016年6月8日	2016年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	203	20,300.00	20,300.00	-

##### 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	股票	停牌	停牌	期末	复牌	复牌	数量 (股)	期末	期末估值总	备注
----	----	----	----	----	----	----	--------	----	-------	----

代码	名称	日期	原因	估值单 价	日期	开盘单 价		成本总额	额	
000511	*ST 烯碳	2016 年 4 月 26 日	重大 事项	8.92	-	-	120,924	1,057,701.75	1,078,642.08	-
000693	ST 华 泽	2016 年 3 月 1 日	重大 事项	12.50	-	-	19,205	382,557.31	240,062.50	-
000582	北部 湾港	2016 年 2 月 29 日	重大 事项	16.32	-	-	6,000	112,822.12	97,920.00	-
002190	成飞 集成	2016 年 4 月 21 日	重大 事项	35.44	2016 年 7 月 12 日	38.98	8,700	354,491.60	308,328.00	-
600497	驰宏 锌锗	2016 年 6 月 13 日	重大 事项	9.97	2016 年 7 月 11 日	10.97	31,700	346,320.27	316,049.00	-
002512	达华 智能	2016 年 6 月 21 日	重大 事项	20.28	2016 年 7 月 21 日	19.38	40,000	756,229.00	811,200.00	-
002249	大洋 电机	2016 年 6 月 8 日	重大 事项	11.97	2016 年 7 月 28 日	10.77	62,850	566,210.28	752,314.50	-
600614	鼎立 股份	2016 年 4 月 26 日	重大 事项	8.14	-	-	48,888	404,392.81	397,948.32	-
002672	东江 环保	2016 年 5 月 23 日	重大 事项	17.33	2016 年 7 月 15 日	19.06	14,837	263,746.65	257,125.21	-
000636	风华 高科	2016 年 3 月 15 日	重大 事项	8.84	2016 年 7 月 13 日	9.72	40,272	376,230.76	356,004.48	-
600166	福田 汽车	2016 年 6 月 30 日	重大 事项	5.52	2016 年 7 月 1 日	5.62	141,300	779,639.76	779,976.00	-
600511	国药 股份	2016 年 2 月 18 日	重大 事项	27.42	2016 年 8 月 4 日	30.16	19,892	639,460.09	545,438.64	-
000547	航天 发展	2016 年 4 月 19 日	重大 事项	16.30	-	-	38,300	560,737.59	624,290.00	-
600640	号百 控股	2016 年 4 月 18 日	重大 事项	16.79	2016 年 8 月 22 日	-	11,487	239,427.93	192,866.73	-

000401	冀东水泥	2016年4月6日	重大事项	10.90	2016年7月14日	11.32	28,800	345,335.98	313,920.00	-
300032	金龙机电	2016年6月28日	重大事项	20.10	2016年7月7日	19.80	8,000	148,239.91	160,800.00	-
002663	普邦园林	2016年4月28日	重大事项	7.36	-	-	74,878	506,410.74	551,102.08	-
002373	千方科技	2016年5月12日	重大事项	14.94	2016年8月16日	16.43	35,214	652,663.96	526,097.16	-
000718	苏宁环球	2016年1月4日	重大事项	9.91	2016年7月18日	11.78	146,060	1,469,719.47	1,447,454.60	-
600751	天海投资	2016年2月15日	重大事项	6.11	2016年7月26日	6.72	21,000	201,884.62	128,310.00	-
601168	西部矿业	2016年2月1日	重大事项	6.84	2016年7月22日	6.52	130,700	957,349.98	893,988.00	-
600773	西藏城投	2016年6月30日	重大事项	15.67	-	-	10,565	154,429.58	165,553.55	-
600545	新疆城建	2016年5月31日	重大事项	6.91	-	-	57,542	579,080.42	397,615.22	-
000975	银泰资源	2016年4月19日	重大事项	14.39	-	-	28,786	367,984.81	414,230.54	-
002266	浙富控股	2016年5月25日	重大事项	5.35	-	-	51,140	382,794.40	273,599.00	-
600654	中安消	2016年5月19日	重大事项	18.54	2016年8月8日	20.39	28,279	516,270.81	524,292.66	-
601611	中国核建	2016年6月30日	重大事项	20.92	2016年7月1日	23.01	7,059	24,494.73	147,674.28	-
601005	重庆钢铁	2016年6月2日	重大事项	2.52	-	-	123,200	446,966.66	310,464.00	-
600759	洲际油气	2016年6月	重大事项	7.58	2016年7月	8.10	27,299	233,926.94	206,926.42	-

		27 日			11 日				
--	--	------	--	--	------	--	--	--	--

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，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 2016 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券占基金净值比 0.07%（2015 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 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,574,785.63	-	-	-	15,574,785.63
结算备付金	726,011.32	-	-	-	726,011.32
存出保证金	45,136.23	-	-	-	45,136.23
交易性金融资产	-	189,616.00	20,300.00	289,304,936.11	289,514,852.11
应收证券清算款	-	-	-	297,114.50	297,114.50
应收利息	-	-	-	3,594.55	3,594.55
应收申购款	-	-	-	98,795.32	98,795.32
资产总计	16,345,933.18	189,616.00	20,300.00	289,704,440.48	306,260,289.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	734,235.54	734,235.54
应付管理人报酬	-	-	-	183,411.86	183,411.86
应付托管费	-	-	-	36,682.37	36,682.37
应付交易费用	-	-	-	313,978.77	313,978.77
其他负债	-	-	-	377,688.39	377,688.39
负债总计	-	-	-	1,645,996.93	1,645,996.93
利率敏感度缺口	16,345,933.18	189,616.00	20,300.00	288,058,443.55	304,614,292.73
上年度末 2015 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	24,436,635.67	-	-	-	24,436,635.67
结算备付金	278,250.73	-	-	-	278,250.73
存出保证金	117,159.81	-	-	-	117,159.81
交易性金融资产	-	-	-	333,968,251.07	333,968,251.07
应收利息	-	-	-	3,936.36	3,936.36
应收申购款	-	-	-	95,732.62	95,732.62
资产总计	24,832,046.21	-	-	334,067,920.05	358,899,966.26
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,065.72	1,065.72
应付赎回款	-	-	-	516,140.14	516,140.14
应付管理人报酬	-	-	-	232,221.33	232,221.33
应付托管费	-	-	-	46,444.27	46,444.27
应付交易费用	-	-	-	527,980.21	527,980.21

其他负债	-	-	-	483,038.93	483,038.93
负债总计	-	-	-	1,806,890.60	1,806,890.60
利率敏感度缺口	24,832,046.21	-	-	-332,261,029.45	357,093,075.66

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 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.07%。

（2015 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（2015 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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金资 产净值比



		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	289,304,936.11	94.97	333,968,251.07	93.52
交易性金融资产-基金投资	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融资产-贵金属投资	0.00	0.00	0.00	0.00
衍生金融资产-权证投资	0.00	0.00	0.00	0.00
其他	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	289,304,936.11	94.97	333,968,251.07	93.52

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2016 年 6 月 30 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	19,430,033.54	16,664,480.35
	业绩比较基准下降 5%	-19,430,033.54	-16,664,480.35

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	289,304,936.11	94.46
	其中: 股票	289,304,936.11	94.46
2	固定收益投资	209,916.00	0.07
	其中: 债券	209,916.00	0.07
	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	16,300,796.95	5.32
7	其他各项资产	444,640.60	0.15

8	合计	306,260,289.66	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境内股票投资组合

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	6,791,629.30	2.23
B	采矿业	7,357,007.91	2.42
C	制造业	162,068,891.52	53.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,915,093.13	2.27
E	建筑业	7,615,862.16	2.50
F	批发和零售业	21,338,189.29	7.00
G	交通运输、仓储和邮政业	12,376,204.08	4.06
H	住宿和餐饮业	1,059,678.20	0.35
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,375,280.61	4.39
J	金融业	4,570,292.12	1.50
K	房地产业	27,276,983.08	8.95
L	租赁和商务服务业	3,946,992.47	1.30
M	科学研究和技术服务业	694,231.86	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	1,842,772.86	0.60
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,732,109.60	0.57
R	文化、体育和娱乐业	4,620,866.56	1.52
S	综合	5,095,145.76	1.67
	合计	288,677,230.51	94.77

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	394,191.52	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	147,674.28	0.05
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	65,713.70	0.02
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	20,126.10	0.01
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	627,705.60	0.21

### 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	601012	隆基股份	400,524	5,226,838.20	1.72
2	600200	江苏吴中	217,894	4,220,606.78	1.39
3	600879	航天电子	232,958	3,629,485.64	1.19
4	600498	烽火通信	140,400	3,408,912.00	1.12
5	600823	世茂股份	499,427	3,391,109.33	1.11
6	600522	中天科技	344,243	3,373,581.40	1.11
7	002309	中利科技	176,131	3,154,506.21	1.04
8	000656	金科股份	813,700	3,108,334.00	1.02
9	601000	唐山港	780,960	3,030,124.80	0.99
10	600736	苏州高新	322,913	2,948,195.69	0.97
11	600859	王府井	191,749	2,922,254.76	0.96
12	600816	安信信托	173,000	2,918,510.00	0.96
13	002466	天齐锂业	65,640	2,802,171.60	0.92
14	002221	东华能源	219,818	2,679,581.42	0.88
15	600664	哈药股份	318,060	2,636,717.40	0.87
16	600329	中新药业	144,262	2,491,404.74	0.82

17	600026	中海发展	419,656	2,475,970.40	0.81
18	002477	雏鹰农牧	412,212	2,460,905.64	0.81
19	600201	生物股份	84,200	2,301,186.00	0.76
20	600240	华业资本	226,354	2,268,067.08	0.74
21	000028	国药一致	34,657	2,256,170.70	0.74
22	600270	外运发展	125,922	2,202,375.78	0.72
23	600835	上海机电	113,946	2,186,623.74	0.72
24	600657	信达地产	426,634	2,124,637.32	0.70
25	600826	兰生股份	79,328	2,076,807.04	0.68
26	600651	飞乐音响	160,291	2,029,284.06	0.67
27	000550	江铃汽车	82,591	2,011,916.76	0.66
28	600487	亨通光电	159,072	2,001,125.76	0.66
29	000012	南玻 A	173,804	1,991,793.84	0.65
30	600808	马钢股份	825,400	1,989,214.00	0.65
31	600635	大众公用	309,787	1,868,015.61	0.61
32	600079	人福医药	107,500	1,802,775.00	0.59
33	600978	宜华生活	160,954	1,793,027.56	0.59
34	000786	北新建材	194,524	1,766,277.92	0.58
35	300244	迪安诊断	52,520	1,732,109.60	0.57
36	000050	深天马 A	82,400	1,719,688.00	0.56
37	000703	恒逸石化	173,806	1,715,465.22	0.56
38	600325	华发股份	153,853	1,703,152.71	0.56
39	600655	豫园商城	154,700	1,676,948.00	0.55
40	002701	奥瑞金	188,053	1,660,507.99	0.55
41	000887	中鼎股份	74,998	1,658,205.78	0.54
42	002595	豪迈科技	76,200	1,628,394.00	0.53
43	600580	卧龙电气	142,086	1,592,784.06	0.52
44	002714	牧原股份	31,500	1,591,695.00	0.52
45	000930	中粮生化	138,447	1,520,148.06	0.50
46	600517	置信电气	156,932	1,492,423.32	0.49
47	600643	爱建集团	152,472	1,489,651.44	0.49
48	000718	苏宁环球	146,060	1,447,454.60	0.48
49	000501	鄂武商 A	92,204	1,446,680.76	0.47
50	002191	劲嘉股份	123,324	1,429,325.16	0.47
51	300182	捷成股份	81,900	1,401,309.00	0.46
52	002400	省广股份	97,420	1,376,544.60	0.45
53	300291	华录百纳	56,817	1,336,904.01	0.44
54	000062	深圳华强	48,900	1,320,300.00	0.43
55	002308	威创股份	78,659	1,292,367.37	0.42

56	603567	珍宝岛	57,200	1,249,820.00	0.41
57	600851	海欣股份	93,704	1,247,200.24	0.41
58	002503	搜于特	99,460	1,235,293.20	0.41
59	603568	伟明环保	52,950	1,223,145.00	0.40
60	000671	阳光城	203,795	1,210,542.30	0.40
61	002049	紫光国芯	26,800	1,177,860.00	0.39
62	600284	浦东建设	112,806	1,177,694.64	0.39
63	600236	桂冠电力	171,500	1,152,480.00	0.38
64	002085	万丰奥威	66,900	1,150,011.00	0.38
65	002179	中航光电	26,480	1,147,113.60	0.38
66	600557	康缘药业	69,990	1,142,936.70	0.38
67	002405	四维图新	46,274	1,138,340.40	0.37
68	603355	莱克电气	29,700	1,131,570.00	0.37
69	002368	太极股份	31,841	1,131,310.73	0.37
70	600195	中牧股份	60,734	1,111,432.20	0.36
71	000511	*ST 烯碳	120,924	1,078,642.08	0.35
72	000998	隆平高科	55,902	1,061,019.96	0.35
73	600754	锦江股份	31,670	1,059,678.20	0.35
74	002131	利欧股份	61,700	1,054,453.00	0.35
75	002463	沪电股份	199,519	1,053,460.32	0.35
76	601515	东风股份	93,063	1,051,611.90	0.35
77	600743	华远地产	221,944	1,049,795.12	0.34
78	600673	东阳光科	165,349	1,033,431.25	0.34
79	600436	片仔癀	22,700	1,021,727.00	0.34
80	300026	红日药业	58,200	1,012,098.00	0.33
81	300202	聚龙股份	41,422	1,002,826.62	0.33
82	002004	华邦健康	108,935	994,576.55	0.33
83	300199	翰宇药业	48,400	984,940.00	0.32
84	002001	新和成	45,800	967,754.00	0.32
85	000983	西山煤电	118,400	964,960.00	0.32
86	000566	海南海药	87,854	958,487.14	0.31
87	002310	东方园林	39,900	954,408.00	0.31
88	600176	中国巨石	99,424	951,487.68	0.31
89	002038	双鹭药业	31,200	941,616.00	0.31
90	600151	航天机电	82,543	932,735.90	0.31
91	002092	中泰化学	109,568	926,945.28	0.30
92	002340	格林美	103,704	909,484.08	0.30
93	600219	南山铝业	122,800	908,720.00	0.30
94	600594	益佰制药	56,800	907,664.00	0.30

95	002439	启明星辰	35,000	904,050.00	0.30
96	000681	视觉中国	38,000	898,700.00	0.30
97	002384	东山精密	45,156	896,798.16	0.29
98	601168	西部矿业	130,700	893,988.00	0.29
99	603019	中科曙光	22,300	887,986.00	0.29
100	600499	科达洁能	52,400	886,084.00	0.29
101	002074	国轩高科	22,300	880,181.00	0.29
102	600418	江淮汽车	69,368	879,586.24	0.29
103	600525	长园集团	62,597	866,968.45	0.28
104	000652	泰达股份	183,604	844,578.40	0.28
105	600478	科力远	69,948	844,272.36	0.28
106	000997	新大陆	41,286	827,371.44	0.27
107	600426	华鲁恒升	93,436	823,171.16	0.27
108	600482	中国动力	25,000	819,250.00	0.27
109	300039	上海凯宝	80,438	818,054.46	0.27
110	600639	浦东金桥	32,711	817,120.78	0.27
111	002512	达华智能	40,000	811,200.00	0.27
112	002325	洪涛股份	86,550	795,394.50	0.26
113	000400	许继电气	51,300	792,072.00	0.26
114	002276	万马股份	39,501	782,514.81	0.26
115	600166	福田汽车	141,300	779,976.00	0.26
116	600266	北京城建	62,200	776,878.00	0.26
117	000078	海王生物	104,377	775,521.11	0.25
118	002030	达安基因	27,867	774,702.60	0.25
119	002657	中科金财	14,100	774,654.00	0.25
120	002437	誉衡药业	88,455	769,558.50	0.25
121	002223	鱼跃医疗	24,137	765,625.64	0.25
122	600812	华北制药	121,834	756,589.14	0.25
123	600500	中化国际	83,600	755,744.00	0.25
124	600435	北方导航	56,772	755,635.32	0.25
125	002249	大洋电机	62,850	752,314.50	0.25
126	000970	中科三环	51,300	744,363.00	0.24
127	600171	上海贝岭	42,762	742,775.94	0.24
128	601699	潞安环能	112,100	733,134.00	0.24
129	002269	美邦服饰	166,400	732,160.00	0.24
130	600528	中铁二局	62,700	727,947.00	0.24
131	601880	大连港	122,853	726,061.23	0.24
132	000031	中粮地产	76,083	717,462.69	0.24
133	002353	杰瑞股份	37,200	717,216.00	0.24

134	002410	广联达	49,500	707,850.00	0.23
135	600058	五矿发展	37,700	707,629.00	0.23
136	600811	东方集团	105,200	700,632.00	0.23
137	600312	平高电气	44,712	700,189.92	0.23
138	002051	中工国际	35,460	697,498.20	0.23
139	600633	浙报传媒	46,300	696,352.00	0.23
140	600143	金发科技	107,400	691,656.00	0.23
141	600160	巨化股份	64,700	687,761.00	0.23
142	002366	台海核电	12,900	687,699.00	0.23
143	000513	丽珠集团	14,848	684,641.28	0.22
144	000982	中银绒业	112,858	680,533.74	0.22
145	002161	远望谷	45,420	676,303.80	0.22
146	000937	冀中能源	127,000	675,640.00	0.22
147	002002	鸿达兴业	35,800	673,040.00	0.22
148	601929	吉视传媒	165,000	664,950.00	0.22
149	002603	以岭药业	41,700	663,447.00	0.22
150	600198	大唐电信	32,896	653,972.48	0.21
151	000600	建投能源	74,900	653,877.00	0.21
152	000598	兴蓉环境	123,800	653,664.00	0.21
153	002013	中航机电	48,277	650,773.96	0.21
154	600516	方大炭素	71,200	650,768.00	0.21
155	600565	迪马股份	100,200	647,292.00	0.21
156	000581	威孚高科	31,700	639,072.00	0.21
157	600388	龙净环保	50,600	635,536.00	0.21
158	000758	中色股份	81,700	633,175.00	0.21
159	600392	盛和资源	38,622	632,628.36	0.21
160	600120	浙江东方	29,087	631,478.77	0.21
161	002371	七星电子	14,975	626,254.50	0.21
162	000547	航天发展	38,300	624,290.00	0.20
163	300147	香雪制药	41,946	617,864.58	0.20
164	002375	亚厦股份	54,400	614,720.00	0.20
165	600787	中储股份	82,234	610,998.62	0.20
166	600180	瑞茂通	40,238	607,996.18	0.20
167	600316	洪都航空	30,700	598,957.00	0.20
168	600536	中国软件	23,775	592,473.00	0.19
169	000939	凯迪生态	65,422	585,526.90	0.19
170	600717	天津港	67,300	584,837.00	0.19
171	002268	卫士通	16,300	582,562.00	0.19
172	600348	阳泉煤业	89,800	572,026.00	0.19

173	600597	光明乳业	44,700	566,796.00	0.19
174	000979	中弘股份	206,484	565,766.16	0.19
175	600809	山西汾酒	25,300	561,154.00	0.18
176	000541	佛山照明	54,506	560,866.74	0.18
177	600380	健康元	60,961	559,621.98	0.18
178	600645	中源协和	15,899	558,690.86	0.18
179	600755	厦门国贸	69,713	554,218.35	0.18
180	000587	金洲慈航	35,882	553,659.26	0.18
181	002663	普邦园林	74,878	551,102.08	0.18
182	002271	东方雨虹	31,972	550,877.56	0.18
183	600017	日照港	135,907	550,423.35	0.18
184	600511	国药股份	19,892	545,438.64	0.18
185	600466	蓝光发展	63,700	545,272.00	0.18
186	002285	世联行	68,800	535,952.00	0.18
187	002018	华信国际	56,050	532,475.00	0.17
188	002373	千方科技	35,214	526,097.16	0.17
189	000519	江南红箭	41,308	525,024.68	0.17
190	600654	中安消	28,279	524,292.66	0.17
191	603369	今世缘	38,920	522,306.40	0.17
192	600039	四川路桥	130,350	513,579.00	0.17
193	002498	汉缆股份	117,500	509,950.00	0.17
194	600584	长电科技	24,941	506,052.89	0.17
195	600320	振华重工	118,804	504,917.00	0.17
196	600757	长江传媒	59,044	495,379.16	0.16
197	002041	登海种业	31,390	487,800.60	0.16
198	002344	海宁皮城	49,500	482,625.00	0.16
199	600108	亚盛集团	93,200	470,660.00	0.15
200	002311	海大集团	29,680	468,053.60	0.15
201	002219	恒康医疗	42,065	464,818.25	0.15
202	600765	中航重机	31,495	459,197.10	0.15
203	600729	重庆百货	18,371	455,600.80	0.15
204	000088	盐田港	69,636	448,455.84	0.15
205	600169	太原重工	114,000	444,600.00	0.15
206	000690	宝新能源	63,960	433,648.80	0.14
207	601801	皖新传媒	36,872	430,296.24	0.14
208	600575	皖江物流	99,356	430,211.48	0.14
209	000612	焦作万方	59,862	427,414.68	0.14
210	600872	中炬高新	34,378	424,224.52	0.14
211	600503	华丽家族	45,700	419,069.00	0.14



212	000158	常山股份	30,000	416,700.00	0.14
213	601010	文峰股份	80,223	416,357.37	0.14
214	002390	信邦制药	44,987	415,679.88	0.14
215	000975	银泰资源	28,786	414,230.54	0.14
216	000021	深科技	37,356	411,289.56	0.14
217	600614	鼎立股份	48,888	397,948.32	0.13
218	600545	新疆城建	57,542	397,615.22	0.13
219	000667	美好集团	111,291	397,308.87	0.13
220	600428	中远航运	70,322	394,506.42	0.13
221	300072	三聚环保	14,208	392,709.12	0.13
222	600366	宁波韵升	15,980	381,442.60	0.13
223	300113	顺网科技	9,861	374,323.56	0.12
224	300253	卫宁健康	14,950	369,265.00	0.12
225	600521	华海药业	14,913	362,684.16	0.12
226	002572	索菲亚	6,400	358,528.00	0.12
227	000636	风华高科	40,272	356,004.48	0.12
228	000829	天音控股	26,197	349,729.95	0.11
229	000661	长春高新	3,264	348,203.52	0.11
230	002426	胜利精密	35,100	345,735.00	0.11
231	600422	昆药集团	25,114	342,554.96	0.11
232	002118	紫鑫药业	22,798	335,130.60	0.11
233	002508	老板电器	8,799	323,539.23	0.11
234	000726	鲁泰 A	28,862	320,656.82	0.11
235	600497	驰宏锌锗	31,700	316,049.00	0.10
236	600699	均胜电子	8,242	315,668.60	0.10
237	002078	太阳纸业	64,394	314,242.72	0.10
238	000401	冀东水泥	28,800	313,920.00	0.10
239	600184	光电股份	13,840	313,337.60	0.10
240	601005	重庆钢铁	123,200	310,464.00	0.10
241	002273	水晶光电	11,046	309,177.54	0.10
242	002190	成飞集成	8,700	308,328.00	0.10
243	000748	长城信息	15,600	306,072.00	0.10
244	000988	华工科技	14,950	299,747.50	0.10
245	600122	宏图高科	21,982	294,119.16	0.10
246	600158	中体产业	16,371	290,585.25	0.10
247	300088	长信科技	19,500	289,965.00	0.10
248	000592	平潭发展	42,400	287,472.00	0.09
249	600761	安徽合力	28,275	285,294.75	0.09
250	002414	高德红外	10,350	279,139.50	0.09

251	600433	冠豪高新	32,300	279,072.00	0.09
252	002299	圣农发展	10,709	277,363.10	0.09
253	002022	科华生物	12,854	273,918.74	0.09
254	002266	浙富控股	51,140	273,599.00	0.09
255	600138	中青旅	13,916	268,857.12	0.09
256	300055	万邦达	14,600	265,866.00	0.09
257	002168	深圳惠程	18,834	265,182.72	0.09
258	002573	清新环境	15,252	258,063.84	0.08
259	002672	东江环保	14,837	257,125.21	0.08
260	600094	大名城	26,200	248,900.00	0.08
261	002050	三花股份	25,562	246,673.30	0.08
262	002244	滨江集团	36,692	245,836.40	0.08
263	000762	西藏矿业	9,890	244,480.80	0.08
264	000697	炼石有色	10,677	243,969.45	0.08
265	600410	华胜天成	21,434	240,489.48	0.08
266	000693	ST 华泽	19,205	240,062.50	0.08
267	002048	宁波华翔	10,272	234,920.64	0.08
268	600770	综艺股份	18,775	233,936.50	0.08
269	600884	杉杉股份	13,546	233,126.66	0.08
270	300010	立思辰	10,900	228,682.00	0.08
271	000860	顺鑫农业	9,588	228,002.64	0.07
272	600601	方正科技	52,801	227,044.30	0.07
273	002665	首航节能	28,605	225,693.45	0.07
274	600175	美都能源	47,900	225,130.00	0.07
275	300115	长盈精密	10,785	222,171.00	0.07
276	300273	和佳股份	11,370	217,735.50	0.07
277	000727	华东科技	65,600	216,480.00	0.07
278	600259	广晟有色	3,731	213,637.06	0.07
279	002155	湖南黄金	16,200	213,354.00	0.07
280	002267	陕天然气	20,162	211,701.00	0.07
281	300043	互动娱乐	14,900	211,133.00	0.07
282	300001	特锐德	9,700	210,393.00	0.07
283	002217	合力泰	13,700	209,610.00	0.07
284	600881	亚泰集团	43,368	209,033.76	0.07
285	002489	浙江永强	26,329	208,525.68	0.07
286	000878	云南铜业	20,400	207,672.00	0.07
287	002444	巨星科技	10,195	207,162.40	0.07
288	600216	浙江医药	15,700	207,083.00	0.07
289	600759	洲际油气	27,299	206,926.42	0.07

290	600611	大众交通	30,087	204,892.47	0.07
291	603766	隆鑫通用	10,087	203,959.14	0.07
292	601311	骆驼股份	10,254	203,541.90	0.07
293	300274	阳光电源	8,300	202,520.00	0.07
294	000066	长城电脑	15,812	201,603.00	0.07
295	002588	史丹利	16,320	201,552.00	0.07
296	002250	联化科技	13,949	199,749.68	0.07
297	601155	新城控股	21,200	196,312.00	0.06
298	000973	佛塑科技	18,706	195,290.64	0.06
299	600064	南京高科	12,939	193,438.05	0.06
300	600572	康恩贝	29,777	192,954.96	0.06
301	600640	号百控股	11,487	192,866.73	0.06
302	002431	棕榈股份	16,680	191,820.00	0.06
303	600056	中国医药	12,094	191,810.84	0.06
304	002428	云南锗业	10,978	188,602.04	0.06
305	002073	软控股份	15,614	188,148.70	0.06
306	300134	大富科技	6,230	186,650.80	0.06
307	000543	皖能电力	25,851	184,576.14	0.06
308	600260	凯乐科技	11,259	184,197.24	0.06
309	002354	天神娱乐	2,100	183,288.00	0.06
310	000616	海航投资	34,240	182,841.60	0.06
311	000685	中山公用	17,574	182,418.12	0.06
312	001696	宗申动力	16,545	180,671.40	0.06
313	600073	上海梅林	15,776	180,635.20	0.06
314	002699	美盛文化	5,400	180,306.00	0.06
315	600067	冠城大通	24,986	180,149.06	0.06
316	600298	安琪酵母	10,018	178,721.12	0.06
317	002063	远光软件	11,505	177,752.25	0.06
318	002624	完美环球	4,700	177,425.00	0.06
319	601777	力帆股份	15,028	176,879.56	0.06
320	002551	尚荣医疗	7,530	176,051.40	0.06
321	000777	中核科技	7,445	175,404.20	0.06
322	000418	小天鹅 A	5,359	174,810.58	0.06
323	000969	安泰科技	12,374	173,607.22	0.06
324	000810	创维数字	9,600	173,472.00	0.06
325	600161	天坛生物	6,167	171,380.93	0.06
326	000488	晨鸣纸业	21,306	169,169.64	0.06
327	600006	东风汽车	19,043	168,911.41	0.06
328	600267	海正药业	13,900	168,885.00	0.06

329	000848	承德露露	14,086	168,327.70	0.06
330	000006	深振业 A	22,807	168,087.59	0.06
331	600967	北方创业	15,800	167,954.00	0.06
332	600773	西藏城投	10,565	165,553.55	0.05
333	002056	横店东磁	9,704	164,968.00	0.05
334	000816	智慧农业	27,761	164,067.51	0.05
335	002440	闰土股份	10,974	162,963.90	0.05
336	002589	瑞康医药	5,300	162,763.00	0.05
337	000563	陕国投 A	29,532	162,130.68	0.05
338	002640	跨境通	9,200	162,104.00	0.05
339	600694	大商股份	4,200	161,784.00	0.05
340	002281	光迅科技	2,520	161,784.00	0.05
341	600587	新华医疗	6,973	161,006.57	0.05
342	000926	福星股份	13,725	160,994.25	0.05
343	600183	生益科技	17,352	160,853.04	0.05
344	300032	金龙机电	8,000	160,800.00	0.05
345	600970	中材国际	25,450	160,335.00	0.05
346	600062	华润双鹤	8,700	158,514.00	0.05
347	002642	荣之联	6,000	157,860.00	0.05
348	600220	江苏阳光	34,558	157,584.48	0.05
349	600086	东方金钰	16,222	157,028.96	0.05
350	600880	博瑞传播	18,400	156,584.00	0.05
351	600416	湘电股份	12,521	156,136.87	0.05
352	600869	智慧能源	15,054	155,056.20	0.05
353	002505	大康农业	39,670	154,713.00	0.05
354	600537	亿晶光电	19,928	153,644.88	0.05
355	600187	国中水务	34,300	152,978.00	0.05
356	600289	亿阳信通	10,907	152,588.93	0.05
357	002396	星网锐捷	7,737	152,418.90	0.05
358	600409	三友化工	22,402	150,989.48	0.05
359	000961	中南建设	26,842	150,583.62	0.05
360	600993	马应龙	7,224	150,475.92	0.05
361	600277	亿利洁能	25,200	149,940.00	0.05
362	002025	航天电器	6,067	149,794.23	0.05
363	002681	奋达科技	8,868	149,691.84	0.05
364	600458	时代新材	9,590	149,412.20	0.05
365	603188	亚邦股份	8,300	149,068.00	0.05
366	002261	拓维信息	10,700	147,981.00	0.05
367	002011	盾安环境	13,105	147,824.40	0.05

368	002358	森源电气	9,512	146,770.16	0.05
369	600563	法拉电子	3,223	146,710.96	0.05
370	000620	新华联	16,033	146,701.95	0.05
371	600460	士兰微	18,269	144,873.17	0.05
372	000572	海马汽车	27,801	144,287.19	0.05
373	002106	莱宝高科	12,000	142,560.00	0.05
374	600850	华东电脑	4,947	141,929.43	0.05
375	002254	泰和新材	10,344	141,919.68	0.05
376	600125	铁龙物流	22,263	141,815.31	0.05
377	600805	悦达投资	16,175	140,399.00	0.05
378	000877	天山股份	22,548	139,346.64	0.05
379	002005	德豪润达	23,530	139,062.30	0.05
380	600112	天成控股	12,321	137,502.36	0.05
381	600894	广日股份	10,262	136,792.46	0.04
382	000669	金鸿能源	8,166	136,372.20	0.04
383	600004	白云机场	11,058	135,571.08	0.04
384	002242	九阳股份	7,441	135,277.38	0.04
385	601717	郑煤机	23,605	134,548.50	0.04
386	000861	海印股份	27,167	134,204.98	0.04
387	000869	张裕 A	3,300	132,594.00	0.04
388	600395	盘江股份	16,000	132,160.00	0.04
389	600351	亚宝药业	13,123	131,623.69	0.04
390	002479	富春环保	11,706	131,458.38	0.04
391	002093	国脉科技	10,550	130,925.50	0.04
392	601139	深圳燃气	16,200	129,600.00	0.04
393	000596	古井贡酒	2,700	129,465.00	0.04
394	002317	众生药业	10,702	128,316.98	0.04
395	600751	天海投资	21,000	128,310.00	0.04
396	000090	天健集团	14,304	125,875.20	0.04
397	002635	安洁科技	3,269	125,464.22	0.04
398	002028	思源电气	11,324	123,997.80	0.04
399	000528	柳工	19,000	123,120.00	0.04
400	600496	精工钢构	28,823	122,785.98	0.04
401	600628	新世界	10,369	122,354.20	0.04
402	002277	友阿股份	10,441	120,280.32	0.04
403	600750	江中药业	3,782	120,267.60	0.04
404	300257	开山股份	7,200	118,944.00	0.04
405	002128	露天煤业	15,700	117,907.00	0.04
406	000552	靖远煤电	32,918	115,871.36	0.04

407	601886	江河集团	11,200	115,024.00	0.04
408	000099	中信海直	8,822	114,686.00	0.04
409	002482	广田集团	15,037	113,980.46	0.04
410	600509	天富能源	15,358	112,881.30	0.04
411	601001	大同煤业	20,500	110,085.00	0.04
412	000049	德赛电池	2,608	109,379.52	0.04
413	002727	一心堂	4,328	108,200.00	0.04
414	600053	九鼎投资	3,100	107,353.00	0.04
415	600831	广电网络	8,247	106,881.12	0.04
416	600059	古越龙山	10,288	105,863.52	0.03
417	601126	四方股份	9,990	105,194.70	0.03
418	600292	远达环保	8,243	104,438.81	0.03
419	000897	津滨发展	26,922	104,188.14	0.03
420	603077	和邦生物	20,900	102,828.00	0.03
421	600300	维维股份	17,122	101,704.68	0.03
422	000680	山推股份	20,577	101,444.61	0.03
423	002064	华峰氨纶	21,122	101,385.60	0.03
424	601666	平煤股份	24,600	100,614.00	0.03
425	002140	东华科技	6,551	99,968.26	0.03
426	600825	新华传媒	12,521	99,541.95	0.03
427	000900	现代投资	14,695	99,044.30	0.03
428	000830	鲁西化工	21,827	98,658.04	0.03
429	000582	北部湾港	6,000	97,920.00	0.03
430	600282	南钢股份	41,400	97,290.00	0.03
431	002029	七匹狼	9,560	97,034.00	0.03
432	601908	京运通	12,622	96,810.74	0.03
433	600481	双良节能	16,676	95,553.48	0.03
434	000426	兴业矿业	12,640	95,052.80	0.03
435	600456	宝钛股份	4,617	92,894.04	0.03
436	600586	金晶科技	21,468	92,312.40	0.03
437	600790	轻纺城	15,660	91,924.20	0.03
438	000417	合肥百货	11,249	91,004.41	0.03
439	000931	中关村	11,388	90,876.24	0.03
440	002602	世纪华通	4,900	90,797.00	0.03
441	002646	青青稞酒	4,336	89,364.96	0.03
442	601678	滨化股份	17,492	89,034.28	0.03
443	603328	依顿电子	3,004	88,738.16	0.03
444	603806	福斯特	1,700	88,723.00	0.03
445	601233	桐昆股份	8,069	87,629.34	0.03

446	601002	晋亿实业	10,069	87,600.30	0.03
447	600720	祁连山	13,054	87,592.34	0.03
448	601369	陕鼓动力	13,600	86,768.00	0.03
449	002332	仙琚制药	7,685	86,072.00	0.03
450	002251	步步高	6,599	85,589.03	0.03
451	002345	潮宏基	8,734	85,418.52	0.03
452	600551	时代出版	4,261	85,049.56	0.03
453	603883	老百姓	1,700	84,558.00	0.03
454	600748	上实发展	8,771	84,552.44	0.03
455	002698	博实股份	4,376	84,281.76	0.03
456	600776	东方通信	10,005	83,941.95	0.03
457	000919	金陵药业	6,410	83,906.90	0.03
458	002408	齐翔腾达	14,881	81,696.69	0.03
459	002293	罗莱生活	5,882	80,583.40	0.03
460	600596	新安股份	11,050	80,554.50	0.03
461	600280	中央商场	11,832	79,984.32	0.03
462	002342	巨力索具	13,788	79,970.40	0.03
463	603699	纽威股份	4,500	79,830.00	0.03
464	603169	兰石重装	6,400	79,744.00	0.03
465	002181	粤传媒	9,704	79,669.84	0.03
466	002315	焦点科技	1,166	78,658.36	0.03
467	600251	冠农股份	9,830	78,640.00	0.03
468	600141	兴发集团	6,748	77,736.96	0.03
469	601965	中国汽研	8,025	77,120.25	0.03
470	600132	重庆啤酒	5,064	76,922.16	0.03
471	002327	富安娜	8,988	76,487.88	0.03
472	002122	天马股份	12,237	76,114.14	0.02
473	002194	武汉凡谷	5,934	75,836.52	0.02
474	000030	富奥股份	10,376	74,395.92	0.02
475	600801	华新水泥	11,707	73,871.17	0.02
476	600483	福能股份	6,500	73,775.00	0.02
477	600864	哈投股份	6,555	73,612.65	0.02
478	600425	青松建化	17,110	72,717.50	0.02
479	000631	顺发恒业	14,817	72,158.79	0.02
480	600874	创业环保	9,239	71,787.03	0.02
481	603005	晶方科技	1,872	70,892.64	0.02
482	603001	奥康国际	3,323	70,646.98	0.02
483	600617	国新能源	6,100	69,906.00	0.02
484	603698	航天工程	2,500	68,600.00	0.02

485	600335	国机汽车	6,008	67,349.68	0.02
486	601226	华电重工	7,300	66,941.00	0.02
487	600468	百利电气	4,617	65,330.55	0.02
488	603555	贵人鸟	2,600	64,818.00	0.02
489	600088	中视传媒	2,712	64,328.64	0.02
490	600397	安源煤业	14,437	63,811.54	0.02
491	002392	北京利尔	12,660	62,540.40	0.02
492	600618	氯碱化工	4,598	60,371.74	0.02
493	002216	三全食品	6,886	59,219.60	0.02
494	002233	塔牌集团	7,052	56,627.56	0.02
495	600510	黑牡丹	6,413	55,921.36	0.02
496	600971	恒源煤电	10,122	55,873.44	0.02
497	002238	天威视讯	3,797	54,942.59	0.02
498	002745	木林森	1,600	54,384.00	0.02
499	600507	方大特钢	11,056	53,068.80	0.02
500	603589	口子窖	1,400	50,694.00	0.02
501	002461	珠江啤酒	4,176	48,525.12	0.02
502	002678	珠江钢琴	3,855	47,300.85	0.02
503	600917	重庆燃气	3,700	36,815.00	0.01
504	600623	华谊集团	1,700	33,677.00	0.01
505	603025	大豪科技	1,000	33,570.00	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	601611	中国核建	7,059	147,674.28	0.05
2	601127	小康股份	4,081	97,413.47	0.03
3	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.03
4	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.02
5	300518	盛讯达	1,204	56,407.40	0.02
6	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.02
7	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.01
8	601966	玲珑轮胎	2,410	31,281.80	0.01
9	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
10	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
11	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
12	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00



13	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
----	--------	------	-----	----------	------

## 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	601012	隆基股份	4,267,668.60	1.20
2	600200	江苏吴中	3,321,336.00	0.93
3	601000	唐山港	3,055,811.00	0.86
4	600859	王府井	2,884,638.54	0.81
5	600823	世茂股份	2,860,033.78	0.80
6	002309	中利科技	2,715,746.01	0.76
7	000656	金科股份	2,688,837.00	0.75
8	600736	苏州高新	2,683,737.00	0.75
9	600026	中海发展	2,667,986.49	0.75
10	600879	航天电子	2,594,112.00	0.73
11	600498	烽火通信	2,247,145.50	0.63
12	000852	石化机械	2,239,941.00	0.63
13	600329	中新药业	2,182,098.92	0.61
14	600522	中天科技	2,110,672.78	0.59
15	002477	雏鹰农牧	2,099,014.34	0.59
16	600270	外运发展	2,016,475.24	0.56
17	600657	信达地产	1,903,347.70	0.53
18	000028	国药一致	1,897,964.53	0.53
19	600664	哈药股份	1,781,182.09	0.50
20	600808	马钢股份	1,751,500.00	0.49

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	600880	博瑞传播	4,043,750.00	1.13
2	000852	石化机械	2,352,445.57	0.66

3	002493	荣盛石化	2,143,525.00	0.60
4	300267	尔康制药	1,979,162.13	0.55
5	600289	亿阳信通	1,897,623.00	0.53
6	600094	大名城	1,690,932.00	0.47
7	300122	智飞生物	1,627,710.15	0.46
8	600894	广日股份	1,621,019.00	0.45
9	600074	保千里	1,557,559.00	0.44
10	000926	福星股份	1,543,383.00	0.43
11	000078	海王生物	1,508,085.00	0.42
12	600219	南山铝业	1,507,793.96	0.42
13	002311	海大集团	1,473,794.00	0.41
14	600064	南京高科	1,449,942.00	0.41
15	000758	中色股份	1,432,307.60	0.40
16	600435	北方导航	1,430,709.00	0.40
17	600521	华海药业	1,402,585.00	0.39
18	002653	海思科	1,339,354.98	0.38
19	600376	首开股份	1,329,922.00	0.37
20	002340	格林美	1,317,603.87	0.37

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	251,624,163.24
卖出股票收入（成交）总额	234,958,581.44

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	209,916.00	0.07
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	209,916.00	0.07

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110035	白云转债	1,600	189,616.00	0.06
2	127003	海印转债	203	20,300.00	0.01

注：上述债券明细为本基金本报告期末持有的全部债券。

## 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	45,136.23
2	应收证券清算款	297,114.50
3	应收股利	-
4	应收利息	3,594.55
5	应收申购款	98,795.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	444,640.60

#### 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 期末股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 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。

##### 7.12.5.2 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	601611	中国核建	147,674.28	0.05	重大事项

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
14,099	17,698.23	29,268,338.11	11.73%	220,259,035.67	88.27%

### 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	冷利群	694,024.00	7.24%
2	高炜	290,000.00	3.02%
3	黄月明	277,000.00	2.89%
4	罗丽珊	211,325.00	2.20%
5	深圳市博凯保健品有限公司	200,028.00	2.09%
6	张宏旭	200,012.00	2.09%
7	施红梅	197,014.00	2.05%
8	卢翠馨	195,030.00	2.03%
9	陈吉荃	150,042.00	1.57%
10	鹿敏理	119,003.00	1.24%

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	34,706.43	0.0139%

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、基金投资和研究部门负责人本报告期末未持有本基金份额。

(2) 本基金的基金经理本报告期末未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (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	239,018,594.54
本报告期基金总申购份额	90,564,061.57
减:本报告期基金总赎回份额	80,055,282.33
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	249,527,373.78

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，因股东方更换董事代表，原董事 Alessandro Varaldo 先生不再担任公司董事职务。根据股东欧利盛资本资产管理股份公司推荐，并经本公司股东会审议通过，同意由 Andrea Vismara 先生担任本公司董事，Alessandro Varaldo 先生不再担任本公司董事职务。Andrea Vismara 先生任职日期自 2016 年 2 月 2 日起。

报告期内，原监事 Andrea Vismara 先生辞去公司监事职务。根据股东欧利盛资本资产管理股份公司推荐，并经本公司股东会审议通过，同意由 Sandro Vesprini 先生担任本公司监事，Andrea Vismara 先生不再担任本公司监事职务。Sandro Vesprini 先生任职日期自 2016 年 2 月 2 日起。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

## 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期基金投资策略未改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	2	228,724,688.99	47.11%	213,016.07	47.61%	-
中航证券	1	128,869,099.65	26.54%	117,438.73	26.25%	-
长江证券	1	94,682,242.54	19.50%	86,283.64	19.28%	-
银河证券	1	18,489,016.18	3.81%	17,219.40	3.85%	-
广发证券	1	14,789,287.83	3.05%	13,477.61	3.01%	-

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。

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
国信证券	14,593.60	10.04%	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	130,740.00	89.96%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月5日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月5日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月6日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月6日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月8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》	2016 年 1 月 9 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》	2016 年 1 月 12 日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 14 日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 16 日
10	2015 年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 21 日
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》	2016 年 1 月 21 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 22 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 26 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 27 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 28 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》	2016 年 1 月 29 日
17	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与平安证券申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 29 日
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》	2016 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》	2016 年 2 月 23 日
20	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔申购最低金额	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 2 月 24 日

	及赎回持有最低份额的公告	报》	
21	关于旗下基金所持金亚科技 (300028) 估值调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 2 月 24 日
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》	2016 年 2 月 26 日
23	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 2 月 27 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 1 日
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 3 日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与光大证券网上交易和手机客户端申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 10 日
27	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》	2016 年 3 月 17 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》	2016 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》	2016 年 3 月 22 日
30	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 24 日
31	关于旗下基金所持沃森生物 (300142) 估值调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 29 日
32	2015 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 30 日
33	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 30 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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 6 日

	变更的提示性公告	报》	
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》	2016 年 4 月 7 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》	2016 年 4 月 12 日
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 14 日
38	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 14 日
39	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海陆金所资产管理有限公司基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 18 日
40	2016 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 20 日
41	鹏华基金管理有限公司关于增加江苏江南农村商业银行股份有限公司为旗下部分开放式基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 20 日
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》	2016 年 4 月 21 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》	2016 年 4 月 22 日
44	鹏华基金管理有限公司关于增加第一创业证券股份有限公司为我司旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 3 日
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》	2016 年 5 月 5 日
46	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 10 日
47	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 11 日
48	鹏华基金关于旗下部分开放式基金参加中国民生银行直销银行	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 17 日

	“基金通”申购费率优惠活动的公告	报》	
49	鹏华基金管理有限公司关于增加中国民族证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 30 日
50	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中国民生银行股份有限公司开通定投业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 31 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》	2016 年 6 月 1 日
52	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 6 月 8 日
53	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 6 月 14 日
54	鹏华基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户的证件类型公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 6 月 18 日
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》	2016 年 6 月 28 日
56	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购手续费费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 6 月 30 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证 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) 2016 年半年度报告》(原文)。

### 11.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 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  
2016 年 8 月 29 日