

鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)2016 年半年度报告摘要

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

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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，以实现对中国证 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

2.4 信息披露方式

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

§ 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

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) 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

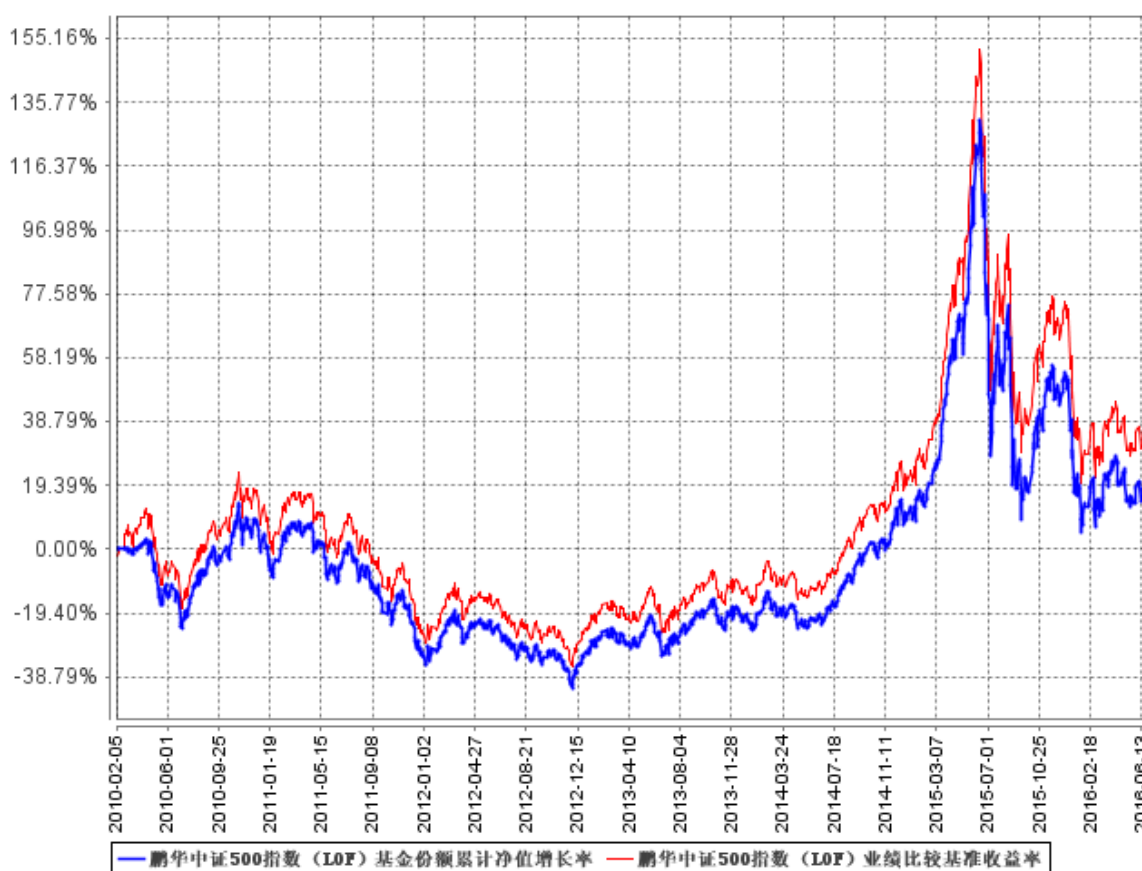
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
资产:			
银行存款		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		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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		297,114.50	-
应收利息		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		-	-
资产总计		306,260,289.66	358,899,966.26
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
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		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		377,688.39	483,038.93
负债合计		1,645,996.93	1,806,890.60
所有者权益:			
实收基金		249,527,373.78	239,018,594.54
未分配利润		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	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
一、收入		-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		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		-25,348,330.52	263,985,513.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益		13,317.35	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,761,901.46	2,013,263.31
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-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）		112,121.84	739,874.35
减：二、费用		2,386,506.01	6,425,026.12
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	1,130,250.99	2,210,237.45
2. 托管费	6.4.8.2.2	226,050.20	442,047.52
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		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		304,736.08	314,572.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-61,722,861.99	295,519,575.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-61,722,861.99	295,519,575.81

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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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。

6.4.8 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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	GpMMZBQCJJEDBSN

6.4.8.1.2 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%	-	-

6.4.8.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.8.1.4 权证交易

注：无。

6.4.8.1.5 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

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×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。

6.4.8.2.2 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×0. 15%÷当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

注: 无。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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

6.4.8.6 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。

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

6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 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	-

6.4.9.1.2 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	-

6.4.9.2 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
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	重大事项	16.30	-	-	38,300	560,737.59	624,290.00	-

		19 日								
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	2016	重大	2.52	-	-	123,200	446,966.66	310,464.00	-

	钢铁	年 6 月 2 日	事项							
600759	洲际 油气	2016 年 6 月 27 日	重大 事项	7.58	2016 年 7 月 11 日	8.10	27,299	233,926.94	206,926.42	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

§ 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	-	-

0	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前十名股票投资明细

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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站 <http://www.phfund.com> 的半年度报告正文。

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前五名股票投资明细

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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网

站 <http://www.phfund.com> 的半年度报告正文。

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前十名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	-	-	-	-	-	-

鹏华基金管理有限公司
2016年8月29日