

鹏华沪深 300 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

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
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.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45

§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末上市基金前十名持有人	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	50
§11 备查文件目录	54
11.1 备查文件目录	54
11.2 存放地点	54
11.3 查阅方式	55

§ 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	202, 558, 871. 07 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	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	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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-16,098,916.87
本期利润	-40,954,101.00
加权平均基金份额本期利润	-0.1955
本期加权平均净值利润率	-16.68%
本期基金份额净值增长率	-14.12%
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	38,806,045.26

期末可供分配基金份额利润	0.1916
期末基金资产净值	241,364,916.33
期末基金份额净值	1.192
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	24.93%

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

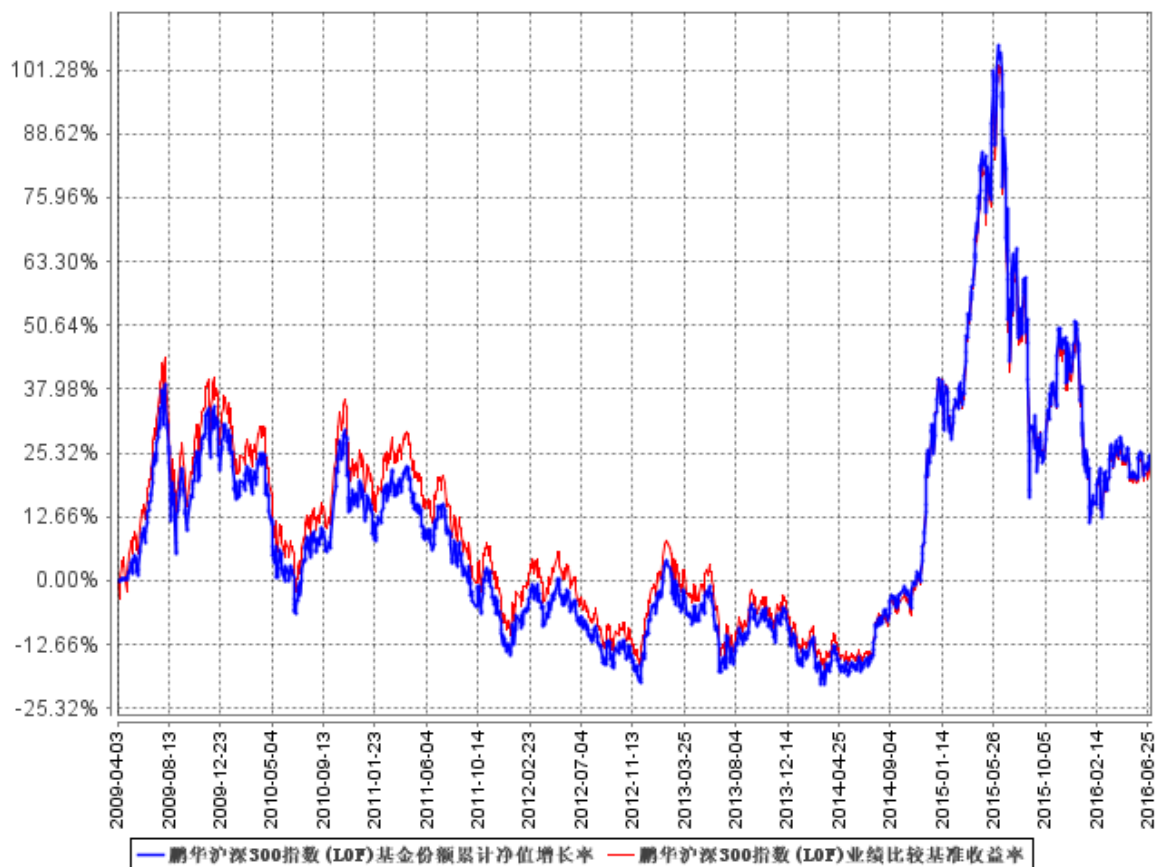
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.25%	0.94%	-0.46%	0.93%	0.71%	0.01%
过去三个月	-0.83%	0.99%	-1.87%	0.96%	1.04%	0.03%
过去六个月	-14.12%	1.84%	-14.65%	1.75%	0.53%	0.09%
过去一年	-28.11%	2.34%	-27.99%	2.19%	-0.12%	0.15%
过去三年	49.19%	1.83%	41.76%	1.75%	7.43%	0.08%
自基金合同生效起至今	24.93%	1.61%	22.93%	1.58%	2.00%	0.03%

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

鹏华沪深300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 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	2014 年 12 月 6 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

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

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 0.53%

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 1.192 元，累计净值 1.252 元；本报告期基金份额净值增长率为-14.12%，业绩比较基准收益率-14.65%。

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低估值的蓝筹股资产，重点关注低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

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 38,806,045.26 元, 期末基金份额净值 1.192 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）本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：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	6.4.7.1	17,163,569.98	19,487,791.40
结算备付金		273,214.34	-
存出保证金		18,021.15	89,269.42
交易性金融资产	6.4.7.2	228,454,306.34	262,979,433.32
其中：股票投资		228,454,306.34	262,949,433.32
基金投资		-	-
债券投资		-	30,000.00
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		1,285,386.95	-
应收利息	6.4.7.5	3,173.65	3,209.16
应收股利		-	-
应收申购款		24,012.14	5,102,481.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		247,221,684.55	287,662,184.39

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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		5,161,397.76	566,984.58
应付管理人报酬		150,212.27	180,695.65
应付托管费		30,042.46	36,139.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	210,641.83	306,125.49
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	304,473.90	411,997.00
负债合计		5,856,768.22	1,501,941.82
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	202,558,871.07	206,218,054.33
未分配利润	6.4.7.10	38,806,045.26	79,942,188.24
所有者权益合计		241,364,916.33	286,160,242.57
负债和所有者权益总计		247,221,684.55	287,662,184.39

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.192 元，基金份额总额 202,558,871.07 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：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
一、收入		-39,117,573.91	162,162,204.97
1.利息收入		59,529.99	139,242.16
其中：存款利息收入	6.4.7.11	59,508.87	139,221.27
债券利息收入		21.12	20.89
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）		-14,348,664.40	275,860,909.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-16,480,376.05	273,326,292.46
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.13	10,321.68	41,272.51
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	2,121,389.97	2,493,344.70
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-24,855,184.13	-114,545,477.53
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	26,744.63	707,530.67
减：二、费用		1,836,527.09	6,728,301.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	915,625.36	2,107,497.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	183,125.03	421,499.48
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	533,576.48	3,983,298.21
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	204,200.22	216,006.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-40,954,101.00	155,433,903.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-40,954,101.00	155,433,903.80

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：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）	206,218,054.33	79,942,188.24	286,160,242.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-40,954,101.00	-40,954,101.00
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）	-3,659,183.26	-182,041.98	-3,841,225.24

其中：1.基金申购款	24,753,684.32	5,100,755.14	29,854,439.46
2.基金赎回款	-28,412,867.58	-5,282,797.12	-33,695,664.70
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)	202,558,871.07	38,806,045.26	241,364,916.33
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)	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

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：

 邓召明 高鹏 郝文高
 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×95%+银行同业存款利率×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 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

本报告期本基金没有发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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	17,163,569.98
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	17,163,569.98

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	244,631,734.03	228,454,306.34	-16,177,427.69
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	244,631,734.03	228,454,306.34	-16,177,427.69

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 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,055.75
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	110.61
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	7.29
合计	3,173.65

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 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	210,641.83
银行间市场应付交易费用	-
合计	210,641.83

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	595.68
预提费用	303,878.22
合计	304,473.90

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	206,218,054.33	206,218,054.33
本期申购	24,753,684.32	24,753,684.32
本期赎回(以“-”号填列)	-28,412,867.58	-28,412,867.58
-基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	202,558,871.07	202,558,871.07

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	147,388,142.14	-67,445,953.90	79,942,188.24
本期利润	-16,098,916.87	-24,855,184.13	-40,954,101.00
本期基金份额交易产生的变动数	-2,064,625.81	1,882,583.83	-182,041.98
其中：基金申购款	17,122,832.71	-12,022,077.57	5,100,755.14
基金赎回款	-19,187,458.52	13,904,661.40	-5,282,797.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	129,224,599.46	-90,418,554.20	38,806,045.26

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	55,974.82
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	3,117.83
其他	416.22
合计	59,508.87

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	174,872,549.72
减：卖出股票成本总额	191,352,925.77
买卖股票差价收入	-16,480,376.05

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	114,347.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	104,000.00
减：应收利息总额	25.72
买卖债券差价收入	10,321.68

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 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,121,389.97
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,121,389.97

6.4.7.16 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	-24,855,184.13
——股票投资	-24,855,184.13
——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	-24,855,184.13

6.4.7.17 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	19,182.82
转换费收入	7,561.81
合计	26,744.63

6.4.7.18 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	533,576.48
银行间市场交易费用	-
合计	533,576.48

6.4.7.19 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	24,863.02
信息披露费	149,179.94
上市年费	29,835.26
银行汇划费用	322.00
合计	204,200.22

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 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	238,231,913.00	67.08%	1,034,032,440.04	41.11%

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	-	-	144,573.40	93.10%

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 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	220,649.84	67.44%	210,641.83	100.00%
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	923,536.33	41.27%	77,857.11	12.82%

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 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	915,625.36	2,107,497.30
其中：支付销售机构的客户维护费	207,197.29	409,007.06

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 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托管费	183,125.03	421,499.48
----------------	------------	------------

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。

6.4.10.2.3 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
中国工商银行	17,163,569.98	55,974.82	22,000,033.23	116,363.71

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

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	证券	成功	可流	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估	备注	

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	值单价	(单位:股)	成本总额	值总额	
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	1,972	25,596.56	25,596.56	-
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	-

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
000002	万科A	2015年12月21日	重大事项	18.20	2016年7月4日	21.99	208,432	2,812,824.44	3,793,462.40	-
000651	格力电器	2016年2月22日	重大事项	19.22	-	-	135,206	2,899,912.98	2,598,659.32	-
600019	宝钢股份	2016年6月27日	重大事项	4.90	-	-	186,771	1,077,152.37	915,177.90	-
600649	城投控股	2016年6月20日	重大事项	14.36	-	-	53,423	804,694.69	767,154.28	-
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事项	8.29	-	-	66,195	667,685.80	548,756.55	-
002465	海格通信	2016年6月13日	重大事项	12.92	-	-	36,246	527,043.74	468,298.32	-
002065	东华软件	2015年12月	重大事项	18.72	2016年7月	22.59	20,998	451,827.61	393,082.56	-

		月 22 日			4 日						
000728	国元 证券	2016 年 6 月 8 日	重 大 事 项	16.72	2016 年 7 月 8 日	17.37	21,039	432,077.41	351,772.08	-	
000415	渤海 金控	2016 年 2 月 1 日	重 大 事 项	6.99	2016 年 8 月 11 日	7.50	48,900	429,119.01	341,811.00	-	
600005	武钢 股份	2016 年 6 月 27 日	重 大 事 项	2.76	-	-	78,500	243,251.21	216,660.00	-	
000629	*ST 钒 钛	2016 年 5 月 26 日	重 大 事 项	2.56	-	-	76,155	226,041.39	194,956.80	-	

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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2015 年 12 月 31 日：0.01%）。

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

部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	17,163,569.98	-	-	-	17,163,569.98
结算备付金	273,214.34	-	-	-	273,214.34
存出保证金	18,021.15	-	-	-	18,021.15
交易性金融资产	-	-	-	228,454,306.34	228,454,306.34
应收证券清算款	-	-	-	1,285,386.95	1,285,386.95
应收利息	-	-	-	3,173.65	3,173.65
应收申购款	-	-	-	24,012.14	24,012.14
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	17,454,805.47	-	-	229,766,879.08	247,221,684.55
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,161,397.76	5,161,397.76
应付管理人报酬	-	-	-	150,212.27	150,212.27
应付托管费	-	-	-	30,042.46	30,042.46
应付交易费用	-	-	-	210,641.83	210,641.83
其他负债	-	-	-	304,473.90	304,473.90
负债总计	-	-	-	5,856,768.22	5,856,768.22
利率敏感度缺口	17,454,805.47	-	-	-223,910,110.86	241,364,916.33
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2015 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	19,487,791.40	-	-	-	19,487,791.40
存出保证金	89,269.42	-	-	-	89,269.42
交易性金融资产		-	30,000.00	262,949,433.32	262,979,433.32
应收利息		-	-	3,209.16	3,209.16
应收申购款		-	-	5,102,481.09	5,102,481.09
资产总计	19,577,060.82	-	30,000.00	268,055,123.57	287,662,184.39
负债					
应付赎回款		-	-	566,984.58	566,984.58
应付管理人报酬		-	-	180,695.65	180,695.65
应付托管费		-	-	36,139.10	36,139.10
应付交易费用		-	-	306,125.49	306,125.49
其他负债		-	-	411,997.00	411,997.00
负债总计		-	-	1,501,941.82	1,501,941.82
利率敏感度缺口	19,577,060.82	-	30,000.00	266,553,181.75	286,160,242.57

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 0.00%。

（2015 年 12 月 31 日：0.01%）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 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	228,454,306.34	94.65	262,949,433.32	91.89
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	228,454,306.34	94.65	262,949,433.32	91.89

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%	12,038,494.90	13,351,289.42
	业绩比较基准下降 5%	-12,038,494.90	-13,351,289.42

注：于 2016 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 94.65%（2015 年 12 月 31 日：91.89%）因此除市场利率和外币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（2015 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	228,454,306.34	92.41
	其中：股票	228,454,306.34	92.41
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	17,436,784.32	7.05
7	其他各项资产	1,330,593.89	0.54
8	合计	247,221,684.55	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	146,044.34	0.06
B	采矿业	6,881,737.53	2.85
C	制造业	69,672,193.18	28.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,017,563.76	3.32
E	建筑业	7,929,468.72	3.29
F	批发和零售业	7,916,589.30	3.28
G	交通运输、仓储和邮政业	6,871,952.55	2.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,882,295.13	6.17
J	金融业	85,292,189.61	35.34
K	房地产业	12,541,639.62	5.20
L	租赁和商务服务业	1,985,698.02	0.82
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,205,548.87	0.50

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	165,006.01	0.07
R	文化、体育和娱乐业	3,879,943.40	1.61
S	综合	708,256.98	0.29
	合计	228,096,127.02	94.50

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	281,006.77	0.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,046.45	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	358,179.32	0.15

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	222,274	7,121,658.96	2.95
2	600016	民生银行	603,862	5,392,487.66	2.23
3	000001	平安银行	612,310	5,327,097.00	2.21
4	600637	东方明珠	213,309	5,177,009.43	2.14
5	600036	招商银行	288,332	5,045,810.00	2.09
6	600109	国金证券	339,680	4,578,886.40	1.90
7	601009	南京银行	471,122	4,423,835.58	1.83
8	601933	永辉超市	1,005,916	4,154,433.08	1.72
9	601600	中国铝业	1,077,917	4,063,747.09	1.68
10	601328	交通银行	699,851	3,940,161.13	1.63
11	000002	万科A	208,432	3,793,462.40	1.57
12	600000	浦发银行	237,712	3,701,175.84	1.53
13	600519	贵州茅台	12,618	3,683,446.56	1.53
14	601166	兴业银行	235,652	3,591,336.48	1.49
15	601601	中国太保	111,679	3,019,800.16	1.25
16	000651	格力电器	135,206	2,598,659.32	1.08
17	601398	工商银行	563,200	2,500,608.00	1.04
18	600999	招商证券	150,618	2,485,197.00	1.03
19	600030	中信证券	152,701	2,478,337.23	1.03
20	601288	农业银行	765,443	2,449,417.60	1.01
21	000333	美的集团	102,636	2,434,525.92	1.01
22	600837	海通证券	154,412	2,381,033.04	0.99
23	601766	中国中车	259,176	2,376,643.92	0.98
24	000776	广发证券	137,540	2,305,170.40	0.96
25	601688	华泰证券	121,215	2,293,387.80	0.95
26	600887	伊利股份	134,087	2,235,230.29	0.93
27	600900	长江电力	167,745	2,095,135.05	0.87
28	601668	中国建筑	379,291	2,017,828.12	0.84
29	601818	光大银行	534,524	2,009,810.24	0.83
30	601169	北京银行	180,316	1,869,876.92	0.77
31	600104	上汽集团	86,307	1,751,169.03	0.73
32	600015	华夏银行	176,781	1,748,364.09	0.72
33	601988	中国银行	530,408	1,702,609.68	0.71
34	600048	保利地产	182,881	1,578,263.03	0.65
35	000858	五粮液	47,280	1,538,018.40	0.64
36	601186	中国铁建	148,092	1,474,996.32	0.61
37	002415	海康威视	66,891	1,435,480.86	0.59

38	000166	申万宏源	167,834	1,411,483.94	0.58
39	000725	京东方 A	600,605	1,387,397.55	0.57
40	002304	洋河股份	18,850	1,355,692.00	0.56
41	600276	恒瑞医药	33,150	1,329,646.50	0.55
42	601390	中国中铁	187,352	1,305,843.44	0.54
43	601989	中国重工	205,697	1,302,062.01	0.54
44	600893	中航动力	31,903	1,105,438.95	0.46
45	600518	康美药业	72,202	1,096,748.38	0.45
46	600011	华能国际	136,154	1,023,878.08	0.42
47	601088	中国神华	72,192	1,015,741.44	0.42
48	000046	泛海控股	98,785	998,716.35	0.41
49	601006	大秦铁路	151,731	977,147.64	0.40
50	001979	招商蛇口	66,245	943,991.25	0.39
51	601800	中国交建	89,061	937,812.33	0.39
52	002024	苏宁云商	85,377	927,194.22	0.38
53	601628	中国人寿	44,349	923,346.18	0.38
54	002594	比亚迪	15,073	919,603.73	0.38
55	000768	中航飞机	46,659	918,715.71	0.38
56	600019	宝钢股份	186,771	915,177.90	0.38
57	600050	中国联通	239,902	914,026.62	0.38
58	000538	云南白药	13,830	889,269.00	0.37
59	601727	上海电气	117,258	886,470.48	0.37
60	600690	青岛海尔	99,146	880,416.48	0.36
61	002450	康得新	50,918	870,697.80	0.36
62	600153	建发股份	72,090	865,080.00	0.36
63	601899	紫金矿业	252,027	849,330.99	0.35
64	600703	三安光电	41,610	830,951.70	0.34
65	300104	乐视网	15,400	814,814.00	0.34
66	601098	中南传媒	44,340	802,997.40	0.33
67	600010	包钢股份	277,539	793,761.54	0.33
68	002252	上海莱士	20,998	791,204.64	0.33
69	600649	城投控股	53,423	767,154.28	0.32
70	002739	万达院线	9,600	767,040.00	0.32
71	601998	中信银行	134,951	765,172.17	0.32
72	601633	长城汽车	89,427	754,763.88	0.31
73	002736	国信证券	43,200	745,200.00	0.31
74	600340	华夏幸福	30,338	739,640.44	0.31
75	601919	中国远洋	144,800	735,584.00	0.30
76	600570	恒生电子	11,000	734,470.00	0.30

77	600958	东方证券	42,900	721,149.00	0.30
78	002230	科大讯飞	21,419	703,614.15	0.29
79	600383	金地集团	67,659	700,947.24	0.29
80	000895	双汇发展	33,268	694,635.84	0.29
81	000625	长安汽车	50,565	691,223.55	0.29
82	000503	海虹控股	17,179	690,767.59	0.29
83	000063	中兴通讯	47,322	678,597.48	0.28
84	600100	同方股份	45,227	676,595.92	0.28
85	002673	西部证券	26,102	674,997.72	0.28
86	000069	华侨城 A	102,799	657,913.60	0.27
87	601111	中国国航	96,451	652,008.76	0.27
88	601985	中国核电	95,300	650,899.00	0.27
89	601857	中国石油	89,873	649,781.79	0.27
90	600705	中航资本	110,104	647,411.52	0.27
91	601099	太平洋	105,110	644,324.30	0.27
92	000540	中天城投	103,300	643,559.00	0.27
93	601211	国泰君安	35,300	627,987.00	0.26
94	600196	复星医药	32,791	623,684.82	0.26
95	600309	万华化学	35,981	622,471.30	0.26
96	002500	山西证券	37,161	615,386.16	0.25
97	000402	金融街	63,162	613,934.64	0.25
98	600118	中国卫星	17,584	590,822.40	0.24
99	002202	金风科技	39,020	590,372.60	0.24
100	000413	东旭光电	67,920	583,432.80	0.24
101	002236	大华股份	44,525	583,277.50	0.24
102	600795	国电电力	199,043	583,195.99	0.24
103	601607	上海医药	32,095	579,314.75	0.24
104	600332	白云山	23,435	577,438.40	0.24
105	600959	江苏有线	40,800	569,568.00	0.24
106	601336	新华保险	13,906	561,802.40	0.23
107	601901	方正证券	73,238	561,003.08	0.23
108	601939	建设银行	117,753	559,326.75	0.23
109	601377	兴业证券	75,310	556,540.90	0.23
110	000686	东北证券	42,936	554,303.76	0.23
111	002129	中环股份	66,195	548,756.55	0.23
112	002142	宁波银行	37,093	548,234.54	0.23
113	600018	上港集团	107,383	547,653.30	0.23
114	601018	宁波港	110,372	546,341.40	0.23
115	600029	南方航空	77,254	545,413.24	0.23

116	300059	东方财富	24,520	544,344.00	0.23
117	002008	大族激光	23,386	534,136.24	0.22
118	002241	歌尔股份	18,618	533,964.24	0.22
119	601958	金铂股份	65,215	531,502.25	0.22
120	601991	大唐发电	136,500	530,985.00	0.22
121	600150	中国船舶	22,562	502,230.12	0.21
122	600068	葛洲坝	86,282	502,161.24	0.21
123	601555	东吴证券	37,328	500,195.20	0.21
124	600111	北方稀土	36,803	489,847.93	0.20
125	600415	小商品城	78,530	485,315.40	0.20
126	601669	中国电建	83,653	477,658.63	0.20
127	600028	中国石化	100,195	472,920.40	0.20
128	600663	陆家嘴	20,749	472,039.75	0.20
129	000100	TCL 集团	142,633	469,262.57	0.19
130	600372	中航电子	24,067	468,584.49	0.19
131	002465	海格通信	36,246	468,298.32	0.19
132	600547	山东黄金	12,034	468,242.94	0.19
133	000793	华闻传媒	47,176	466,098.88	0.19
134	601888	中国国旅	10,567	464,736.66	0.19
135	600398	海澜之家	40,734	460,294.20	0.19
136	601866	中海集运	115,668	458,045.28	0.19
137	300017	网宿科技	6,714	451,180.80	0.19
138	600588	用友网络	23,017	450,672.86	0.19
139	600115	东方航空	67,783	448,045.63	0.19
140	000783	长江证券	38,165	442,714.00	0.18
141	002475	立讯精密	22,526	442,635.90	0.18
142	000876	新希望	52,716	438,597.12	0.18
143	600038	中直股份	10,500	435,540.00	0.18
144	600066	宇通客车	21,775	431,145.00	0.18
145	000712	锦龙股份	20,500	425,580.00	0.18
146	601788	光大证券	25,000	423,500.00	0.18
147	600535	天士力	11,839	423,362.64	0.18
148	601872	招商轮船	89,900	420,732.00	0.17
149	601198	东兴证券	17,100	417,924.00	0.17
150	000729	燕京啤酒	54,975	417,260.25	0.17
151	600600	青岛啤酒	14,153	411,427.71	0.17
152	002195	二三四五	33,400	410,486.00	0.17
153	600027	华电国际	82,890	410,305.50	0.17
154	000423	东阿阿胶	7,757	409,802.31	0.17

155	601898	中煤能源	78,331	404,187.96	0.17
156	600685	中船防务	15,900	403,224.00	0.17
157	002292	奥飞娱乐	13,402	401,389.90	0.17
158	000338	潍柴动力	51,196	399,840.76	0.17
159	600886	国投电力	59,940	395,604.00	0.16
160	600188	兖州煤业	36,114	395,087.16	0.16
161	600741	华域汽车	28,112	393,849.12	0.16
162	002065	东华软件	20,998	393,082.56	0.16
163	300058	蓝色光标	40,440	392,672.40	0.16
164	600406	国电南瑞	29,237	390,898.69	0.16
165	002456	欧菲光	13,128	387,276.00	0.16
166	600271	航天信息	16,218	385,988.40	0.16
167	600816	安信信托	22,800	384,636.00	0.16
168	000883	湖北能源	82,505	381,998.15	0.16
169	600009	上海机场	14,407	375,302.35	0.16
170	000839	中信国安	17,600	375,056.00	0.16
171	600369	西南证券	50,328	365,381.28	0.15
172	600317	营口港	108,300	363,888.00	0.15
173	601106	中国一重	69,600	362,616.00	0.15
174	601808	中海油服	29,778	361,802.70	0.15
175	600804	鹏博士	19,809	361,118.07	0.15
176	000568	泸州老窖	12,140	360,558.00	0.15
177	300251	光线传媒	31,040	358,822.40	0.15
178	300027	华谊兄弟	26,489	358,661.06	0.15
179	600642	申能股份	62,047	356,149.78	0.15
180	600867	通化东宝	17,171	355,267.99	0.15
181	600585	海螺水泥	24,431	355,226.74	0.15
182	600177	雅戈尔	25,703	354,444.37	0.15
183	601992	金隅股份	45,601	353,407.75	0.15
184	000728	国元证券	21,039	351,772.08	0.15
185	600089	特变电工	40,686	346,644.72	0.14
186	300146	汤臣倍健	25,400	343,916.00	0.14
187	600208	新潮中宝	81,097	343,040.31	0.14
188	000415	渤海金控	48,900	341,811.00	0.14
189	600031	三一重工	67,407	338,383.14	0.14
190	600085	同仁堂	11,319	337,193.01	0.14
191	600221	海南航空	105,007	332,872.19	0.14
192	600489	中金黄金	29,416	330,635.84	0.14
193	000009	中国宝安	23,983	328,567.10	0.14

194	600583	海油工程	47,079	325,315.89	0.13
195	600674	川投能源	39,284	324,485.84	0.13
196	000039	中集集团	22,762	322,537.54	0.13
197	000559	万向钱潮	20,620	321,672.00	0.13
198	600352	浙江龙盛	37,234	320,957.08	0.13
199	300024	机器人	12,480	316,867.20	0.13
200	002146	荣盛发展	46,998	315,826.56	0.13
201	600660	福耀玻璃	22,525	315,350.00	0.13
202	601618	中国中冶	84,566	312,048.54	0.13
203	600739	辽宁成大	19,895	309,765.15	0.13
204	002385	大北农	37,666	303,587.96	0.13
205	000917	电广传媒	18,106	299,292.18	0.12
206	000157	中联重科	70,938	292,973.94	0.12
207	300070	碧水源	19,539	290,740.32	0.12
208	000963	华东医药	4,287	288,943.80	0.12
209	300003	乐普医疗	15,800	288,192.00	0.12
210	600446	金证股份	8,000	287,600.00	0.12
211	601928	凤凰传媒	27,119	285,834.26	0.12
212	600157	永泰能源	72,291	284,826.54	0.12
213	000623	吉林敖东	11,203	279,514.85	0.12
214	600718	东软集团	15,255	279,471.60	0.12
215	600688	上海石化	45,712	278,843.20	0.12
216	000792	盐湖股份	13,206	278,646.60	0.12
217	300144	宋城演艺	11,100	276,501.00	0.11
218	000630	铜陵有色	107,890	274,040.60	0.11
219	000750	国海证券	37,078	274,006.42	0.11
220	600074	保千里	17,500	261,100.00	0.11
221	600839	四川长虹	59,062	261,054.04	0.11
222	002081	金螳螂	25,866	259,177.32	0.11
223	002007	华兰生物	8,222	258,170.80	0.11
224	000826	启迪桑德	8,409	256,894.95	0.11
225	000999	华润三九	10,328	250,144.16	0.10
226	000060	中金岭南	23,910	249,381.30	0.10
227	600895	张江高科	13,700	247,696.00	0.10
228	300133	华策影视	15,720	244,760.40	0.10
229	000977	浪潮信息	10,300	241,535.00	0.10
230	600485	信威集团	13,400	239,056.00	0.10
231	600023	浙能电力	46,665	237,524.85	0.10
232	000738	中航动控	8,800	232,320.00	0.10

233	300315	掌趣科技	22,100	231,829.00	0.10
234	600820	隧道股份	27,500	230,725.00	0.10
235	000709	河钢股份	83,267	230,649.59	0.10
236	601718	际华集团	30,100	229,964.00	0.10
237	600060	海信电器	12,967	229,256.56	0.09
238	600373	中文传媒	11,004	228,333.00	0.09
239	600376	首开股份	20,400	226,848.00	0.09
240	601333	广深铁路	57,136	223,401.76	0.09
241	600061	国投安信	12,500	222,750.00	0.09
242	600362	江西铜业	16,377	220,761.96	0.09
243	000425	徐工机械	72,040	220,442.40	0.09
244	600256	广汇能源	53,663	220,018.30	0.09
245	002422	科伦药业	14,250	219,592.50	0.09
246	002470	金正大	27,096	218,122.80	0.09
247	600005	武钢股份	78,500	216,660.00	0.09
248	600021	上海电力	21,000	215,670.00	0.09
249	300124	汇川技术	11,099	215,320.60	0.09
250	601117	中国化学	38,664	213,811.92	0.09
251	002153	石基信息	8,105	213,809.90	0.09
252	600737	中粮屯河	18,500	213,675.00	0.09
253	601021	春秋航空	4,300	206,142.00	0.09
254	601258	庞大集团	74,348	204,457.00	0.08
255	601179	中国西电	40,147	203,545.29	0.08
256	601216	君正集团	26,563	198,425.61	0.08
257	600875	东方电气	20,105	197,431.10	0.08
258	600170	上海建工	51,542	197,405.86	0.08
259	000629	*ST 钒钛	76,155	194,956.80	0.08
260	600252	中恒集团	44,220	191,914.80	0.08
261	600037	歌华有线	12,300	187,083.00	0.08
262	603993	洛阳钼业	44,528	184,791.20	0.08
263	000061	农产品	14,991	182,290.56	0.08
264	002294	信立泰	6,618	180,009.60	0.07
265	600098	广州发展	22,400	175,168.00	0.07
266	000778	新兴铸管	37,627	174,589.28	0.07
267	600998	九州通	9,862	172,683.62	0.07
268	000027	深圳能源	26,492	169,018.96	0.07
269	600008	首创股份	43,322	168,522.58	0.07
270	300015	爱尔眼科	4,517	165,006.01	0.07
271	600827	百联股份	13,564	163,853.12	0.07

272	603000	人民网	9,788	162,578.68	0.07
273	000800	一汽轿车	14,486	157,607.68	0.07
274	002424	贵州百灵	9,100	156,520.00	0.06
275	600863	内蒙华电	51,299	154,922.98	0.06
276	300002	神州泰岳	13,800	146,832.00	0.06
277	601118	海南橡胶	26,126	146,044.34	0.06
278	601608	中信重工	26,700	143,379.00	0.06
279	000898	鞍钢股份	36,300	139,029.00	0.06
280	000825	太钢不锈	43,900	138,724.00	0.06
281	600582	天地科技	30,500	137,250.00	0.06
282	600873	梅花生物	21,541	133,769.61	0.06
283	600783	鲁信创投	6,108	131,993.88	0.05
284	600648	外高桥	6,616	130,401.36	0.05
285	002399	海普瑞	6,946	121,277.16	0.05
286	600704	物产中大	12,870	120,463.20	0.05
287	600578	京能电力	28,100	120,268.00	0.05
288	002027	分众传媒	7,200	118,872.00	0.05
289	601225	陕西煤业	22,249	115,027.33	0.05
290	300085	银之杰	3,100	92,690.00	0.04
291	000156	华数传媒	4,900	90,895.00	0.04
292	600022	山东钢铁	37,600	89,112.00	0.04
293	600871	石化油服	20,200	77,568.00	0.03
294	600606	绿地控股	4,600	49,772.00	0.02
295	002568	百润股份	1,900	41,800.00	0.02
296	603885	吉祥航空	1,500	39,375.00	0.02
297	601016	节能风电	2,400	23,832.00	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	601127	小康股份	3,039	72,540.93	0.03
2	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.03
3	300518	盛讯达	1,019	47,740.15	0.02
4	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.02
5	603958	哈森股份	1,964	28,478.00	0.01
6	601966	玲珑轮胎	1,972	25,596.56	0.01
7	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01

8	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
9	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.01
10	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
11	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	600000	浦发银行	7,574,184.15	2.65
2	000001	平安银行	7,088,651.00	2.48
3	600030	中信证券	6,306,028.04	2.20
4	600637	东方明珠	5,026,240.46	1.76
5	600036	招商银行	4,927,293.12	1.72
6	600109	国金证券	4,082,681.38	1.43
7	601933	永辉超市	4,067,080.00	1.42
8	601600	中国铝业	3,976,994.00	1.39
9	601009	南京银行	3,672,315.37	1.28
10	600999	招商证券	2,872,657.45	1.00
11	601919	中国远洋	2,794,737.00	0.98
12	601398	工商银行	2,695,923.00	0.94
13	600519	贵州茅台	2,677,722.78	0.94
14	601601	中国太保	2,518,318.00	0.88
15	600005	武钢股份	2,368,024.00	0.83
16	000776	广发证券	2,243,808.00	0.78
17	601318	中国平安	2,223,252.00	0.78
18	600016	民生银行	2,004,466.40	0.70
19	600649	城投控股	1,968,255.00	0.69
20	002736	国信证券	1,735,308.56	0.61

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	600000	浦发银行	8,118,890.41	2.84
2	600030	中信证券	7,186,369.42	2.51
3	600036	招商银行	4,912,895.68	1.72
4	601318	中国平安	4,194,411.36	1.47
5	600016	民生银行	3,602,354.00	1.26
6	000001	平安银行	3,363,267.08	1.18
7	600005	武钢股份	2,881,541.11	1.01
8	600519	贵州茅台	2,849,385.55	1.00
9	601919	中国远洋	2,536,324.07	0.89
10	601166	兴业银行	2,206,073.00	0.77
11	600837	海通证券	1,970,002.00	0.69
12	601866	中海集运	1,933,966.00	0.68
13	601288	农业银行	1,925,996.00	0.67
14	600649	城投控股	1,799,837.00	0.63
15	001979	招商蛇口	1,730,506.96	0.60
16	601601	中国太保	1,716,258.91	0.60
17	000792	盐湖股份	1,622,066.00	0.57
18	601857	中国石油	1,611,766.50	0.56
19	601169	北京银行	1,559,571.60	0.54
20	002024	苏宁云商	1,474,274.50	0.52

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	181,237,080.37
卖出股票收入（成交）总额	174,872,549.72

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

本基金组合投资的前十名证券之一南京银行股份有限公司（以下简称“南京银行”）于 2016 年 04 月 08 日，中国证券监督管理委员会江苏监管局（以下简称“江苏证监局”）对公司基金销售业务进行了现场检查。公司于近日收到江苏证监局《关于对南京银行股份有限公司采取责令改正措施的决定》（【2016】3 号）。决定主要提出以下问题：一、个别支行基金宣传推介材料存在违规情形；二、公司未出具年度监察稽核报告；三、两项关于基金销售的管理制度未报备；四、基金销售业务规范执行不到位。针对以上问题，江苏证监局决定对公司采取出具责令改正的行政监管措施。公司将依据《证券投资基金销售管理办法》等相关监管规定，进一步加强基金代销业

务的合规管理工作，积极做好上述问题的整改工作。

对上述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，符合指数基金的管理规定，该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其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	18,021.15
2	应收证券清算款	1,285,386.95
3	应收股利	-
4	应收利息	3,173.65
5	应收申购款	24,012.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,330,593.89

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 期末前十名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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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
12,313	16,450.81	5,822,179.81	2.87%	196,736,691.26	97.13%

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	10.04%
2	潮州市恒信医药有限公司	345,500.00	3.99%
3	梁玛丽	305,039.00	3.52%
4	唐万军	300,000.00	3.46%
5	赖交雄	211,799.00	2.44%
6	赫清华	200,006.00	2.31%
7	李宏英	198,013.00	2.29%
8	陈（金监）铭	194,000.00	2.24%
9	李超	159,281.00	1.84%
10	袁忠东	150,690.00	1.74%

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	28,374.90	0.0140%

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（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	206,218,054.33
本报告期基金总申购份额	24,753,684.32
减:本报告期基金总赎回份额	28,412,867.58
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	202,558,871.07

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，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。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

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	238,231,913.00	67.08%	220,649.84	67.44%	-
西南证券	1	81,917,519.56	23.07%	74,651.76	22.82%	-
招商证券	1	30,866,766.80	8.69%	28,129.02	8.60%	-
兴业证券	1	3,378,425.08	0.95%	3,078.96	0.94%	-
国泰君安	1	746,769.00	0.21%	680.53	0.21%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

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

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、选择交易单位的程序：

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位的对象。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
国信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	80,147.40	70.09%	-	-	-	-
招商证券	34,200.00	29.91%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
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	《中国证券报》、《上	2016年1月6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》	
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及赎回持有最低份额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 2 月 24 日
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
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》	2016 年 3 月 22 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 24 日
29	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
30	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
31	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
32	鹏华基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《上	2016 年 4 月 6 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》	
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》	2016 年 4 月 7 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》	2016 年 4 月 12 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》	2016 年 4 月 14 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 14 日
37	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
38	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
39	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
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》	2016 年 4 月 21 日
41	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
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 5 月 5 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 5 月 10 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》	2016 年 5 月 11 日
45	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“基金通”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 5 月 17 日

46	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
47	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
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》	2016 年 6 月 1 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》	2016 年 6 月 8 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》	2016 年 6 月 14 日
51	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
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 28 日
53	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) 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