

# 鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 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

报告送出日期：2016 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	218,855,609.47 份
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。
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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016年7月1日－2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	11,159,819.31
2. 本期利润	14,416,256.19
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0591
4. 期末基金资产净值	279,792,833.65
5. 期末基金份额净值	1.278

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。

#### 3.2 基金净值表现

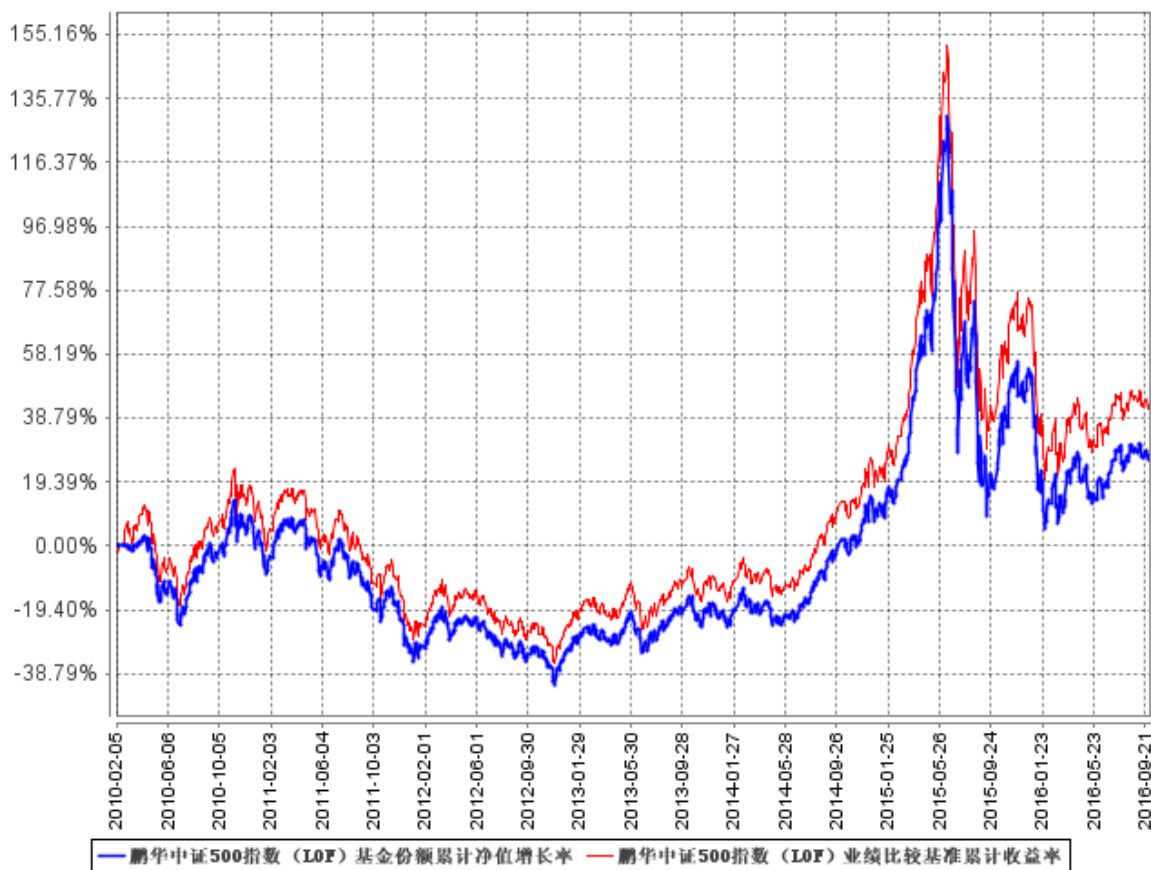
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	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
过去三个月	4.67%	0.97%	3.20%	0.96%	1.47%	0.01%

注：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、本基金基金合同于 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。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2016 年 9 月 24 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

				<p>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 月至 2016 年 9 月担任鹏华中证 500 指数 (LOF) 基金基金经理，2014 年 9 月至 2016 年 9 月兼任鹏华地产分级基金基金经理，2014 年 12 月至 2016 年 9 月兼任鹏华沪深 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发生变动，增聘张羽翔担任本基金基金经理，王咏辉不再担任本基金基金经理。</p>
张羽翔	本基金基金经理	2016 年 9 月 24 日	-	<p>9</p> <p>张羽翔先生，国籍中国，工学硕士，9 年金融证券从业经验。曾任招商银行软件中心 (原深圳市融博技术公司) 数据分析师；2011 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部资深金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员，先后从事金融工程、量化研究等工作；2015 年 9 月起担任鹏华上证民企 50ETF 基金及其联接基金基金经理，2016 年 6 月起兼任鹏华新丝路分级基金基金经理，2016 年 7 月起兼任鹏华高铁产业分级基金基金经理，2016 年 9 月起兼任鹏华中证 500 指数 (LOF)、鹏华沪深 300 指数 (LOF) 基金基金经理。张羽翔先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，增聘张羽翔担任本基金基金经理，王咏辉不再担任本基金基金经理。</p>

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 公平交易专项说明

### 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。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 2 次, 主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内, 基金运作严格按照基金合同的各项要求, 依据被动化指数投资方法进行投资管理。

报告期内, 市场行情趋于稳定, 投资管理操作正常开展。基金日均跟踪偏离度和跟踪误差都有较好的控制。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期末, 基金份额净值为 1.278, 本报告期基金份额净值增长率为 4.67%

## 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

# § 5 投资组合报告

## 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	264,630,975.44	94.19
	其中: 股票	264,630,975.44	94.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,192,392.13	5.76
8	其他资产	133,417.21	0.05
9	合计	280,956,784.78	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	4,838,681.11	1.73
B	采矿业	11,478,020.76	4.10
C	制造业	157,555,630.96	56.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,792,015.19	2.78
E	建筑业	8,975,090.96	3.21
F	批发和零售业	15,526,789.00	5.55
G	交通运输、仓储和邮政业	7,765,123.68	2.78
H	住宿和餐饮业	335,133.50	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,394,141.29	5.86
J	金融业	1,521,707.20	0.54
K	房地产业	18,198,911.62	6.50
L	租赁和商务服务业	3,770,901.14	1.35
M	科学研究和技术服务业	1,136,678.35	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	1,234,694.39	0.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	714,301.20	0.26
R	文化、体育和娱乐业	4,106,347.29	1.47
S	综合	2,494,876.71	0.89
	合计	263,839,044.35	94.30

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	410,437.09	0.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	45,750.11	0.02
F	批发和零售业	23,503.38	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	222,600.31	0.08
J	金融业	89,640.20	0.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	791,931.09	0.28

### 5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

### 5.3 报告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

#### 5.3.1 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300072	三聚环保	40,608	1,770,508.80	0.63
2	002466	天齐锂业	43,340	1,649,087.00	0.59
3	600584	长电科技	71,041	1,378,905.81	0.49
4	600522	中天科技	125,143	1,369,064.42	0.49
5	002310	东方园林	86,350	1,348,787.00	0.48
6	600201	生物股份	41,900	1,301,833.00	0.47
7	002405	四维图新	58,374	1,287,146.70	0.46
8	002085	万丰奥威	62,300	1,279,642.00	0.46
9	600079	人福医药	61,600	1,268,344.00	0.45
10	600487	亨通光电	59,572	1,174,759.84	0.42



### 5.3.2 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	603986	兆易创新	982	174,766.54	0.06
2	603189	网达软件	3,898	105,713.76	0.04
3	300541	先进数通	1,467	66,704.49	0.02
4	603067	振华股份	2,616	65,870.88	0.02
5	300534	陇神戎发	996	55,805.88	0.02

### 5.4 报告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。

### 5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告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。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 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。

#### 5.9.2 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。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 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。

## 5.10.2 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。

## 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

根据中国证监会[2014]103 号文，本基金投资的前十名证券之一万丰奥威

万丰奥威:关于子公司收到环境保护局行政处罚决定书的公告

浙江万丰奥威汽轮股份有限公司

关于子公司收到环境保护局行政处罚决定书的公告

本公司全体董事、监事、高级管理人员保证公告内容的真实、准确和完整，对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

浙江万丰奥威汽轮股份有限公司（以下简称“万丰奥威”或“公司”）全资子公司上海达克罗涂复工业有限公司（以下简称“上海达克罗”）于近日收到上海市宝山区环境保护局（以下简称“宝山区环保局”）《行政处罚决定书》（第 2520160073 号），现将该决定书的主要内容和相关情况公告如下：

#### 一、基本情况

宝山区环保局于 2016 年 3 月对上海达克罗进行了现场检查，发现其小部分生产线存在配套建设的环保设施未经验收、在生产过程中有废气产生等问题。依据国务院《建设项目环境保护管理条例》第二十八条规定，对其作出了停止上述生产线的加工生产和罚款人民币柒万伍仟元整的行政处罚。

#### 二、公司整改情况

公司收到宝山区环保局处罚通知后，高度重视，立即组织召开专题会，研究确定整改方案，并形成如下整改措施：

1. 责令上海达克罗及时履行上述处罚决定；
2. 责令上海达克罗对相关配套设施进行整改并尽快通过环保部门的验收；
3. 公司将进一步提升扩大宁波经济技术开发区达克罗涂复有限公司生产负荷及扩大外协业务，不影响公司整体的生产经营。
4. 公司将以此为戒，认真学习相关法律法规，提高环保意识，增强执行国家环保新规的底线

思维和红线意识，切实维护公司、股东和投资者的利益。

### 三、对公司的影响

公司通过提升宁波经济技术开发区达克罗涂复有限公司生产负荷及扩大外协业务，本次处罚不影响公司的持续生产经营，也不会对公司形成重大不利影响。敬请广大投资者理性投资，注意风险。

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。

本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，按照成份股权重进行配置该证券，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	48,287.30
2	应收证券清算款	5,317.44
3	应收股利	-
4	应收利息	2,754.79
5	应收申购款	77,057.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	133,417.21

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告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。

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
----	------	------	----------------	--------------	----------

1	603986	兆易创新	174,766.54	0.06	重大事项
---	--------	------	------------	------	------

### 5.11.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	249,527,373.78
报告期期间基金总申购份额	15,546,982.40
减：报告期期间基金总赎回份额	46,218,746.71
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	218,855,609.47

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：截止本报告期末，本基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金管理人本报告期末申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 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 年第 3 季度报告》（原文）。

### 8.2 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

### 8.3 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 10 月 25 日