

鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)2016 年第 4 季度报告

2016 年 12 月 31 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：2017 年 1 月 19 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 2017 年 1 月 16 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 10 月 1 日起至 12 月 31 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 | 209,606,407.20 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。 |
| 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10月1日—2016年12月31日） |
|-----------------|-----------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 4,767,110.85 |
| 2. 本期利润 | 1,318,808.16 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0062 |
| 4. 期末基金资产净值 | 268,859,995.67 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.283 |

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

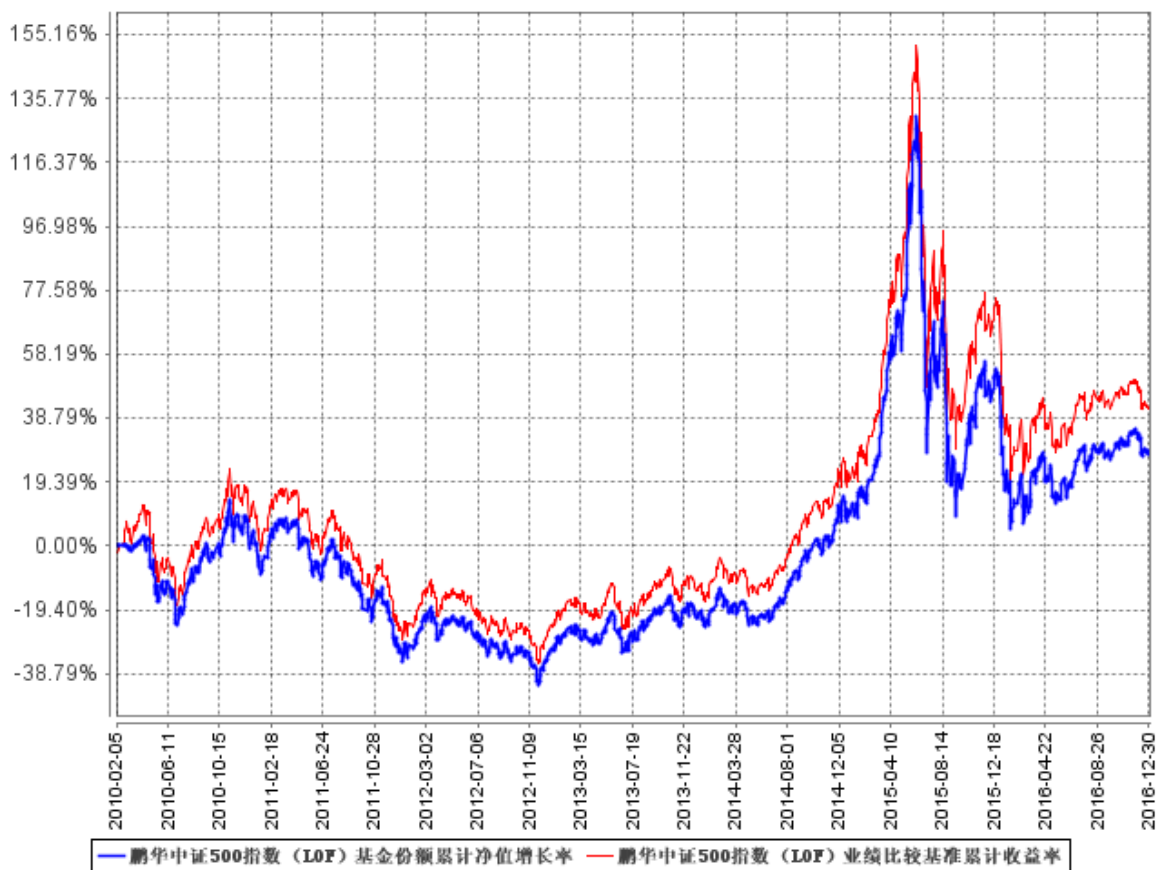
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.39% | 0.78% | -0.95% | 0.78% | 1.34% | 0.00% |

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 | | |
| 张羽翔 | 本基金基金经理 | 2016年9月24日 | - | 9 | 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 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | <p>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,2016年11月起兼任鹏华一带一路分级、鹏华新能源分级基金基金经理。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未发生变动。</p> |
|--|--|--|--|--|---|

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 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 1.283，本报告期基金份额净值增长率为 0.39%。

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 | 253,384,539.83 | 93.91 |
| | 其中：股票 | 253,384,539.83 | 93.91 |
| 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 | 16,096,420.90 | 5.97 |
| 8 | 其他资产 | 349,732.68 | 0.13 |
| 9 | 合计 | 269,830,693.41 | 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 | 3,216,792.10 | 1.20 |
| B | 采矿业 | 10,082,824.46 | 3.75 |
| C | 制造业 | 155,217,227.83 | 57.73 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 7,822,071.59 | 2.91 |
| E | 建筑业 | 7,139,051.95 | 2.66 |
| F | 批发和零售业 | 15,035,167.08 | 5.59 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 7,110,952.06 | 2.64 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 15,119,517.28 | 5.62 |
| J | 金融业 | 2,121,800.88 | 0.79 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| K | 房地产业 | 15,794,886.03 | 5.87 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,719,543.53 | 1.38 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 761,974.20 | 0.28 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,220,790.35 | 0.45 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 133,221.00 | 0.05 |
| Q | 卫生和社会工作 | 672,640.00 | 0.25 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 3,714,040.49 | 1.38 |
| S | 综合 | 2,269,356.50 | 0.84 |
| | 合计 | 251,151,857.33 | 93.41 |

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 | 1,859,159.39 | 0.69 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 15,592.23 | 0.01 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 9,458.68 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 241,692.20 | 0.09 |
| J | 金融业 | 106,780.00 | 0.04 |
| 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 | 2,232,682.50 | 0.83 |

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 | 600522 | 中天科技 | 121,143 | 1,275,635.79 | 0.47 |
| 2 | 000656 | 金科股份 | 238,000 | 1,247,120.00 | 0.46 |
| 3 | 600201 | 生物股份 | 39,000 | 1,232,010.00 | 0.46 |
| 4 | 300136 | 信维通信 | 42,400 | 1,208,400.00 | 0.45 |
| 5 | 600682 | 南京新百 | 31,300 | 1,166,551.00 | 0.43 |
| 6 | 600584 | 长电科技 | 65,241 | 1,151,503.65 | 0.43 |
| 7 | 600079 | 人福医药 | 57,100 | 1,139,145.00 | 0.42 |
| 8 | 600219 | 南山铝业 | 362,850 | 1,121,206.50 | 0.42 |
| 9 | 600643 | 爱建集团 | 89,072 | 1,105,383.52 | 0.41 |
| 10 | 600487 | 亨通光电 | 57,572 | 1,074,293.52 | 0.40 |

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 | 603589 | 口子窖 | 19,000 | 610,470.00 | 0.23 |
| 2 | 603528 | 多伦科技 | 4,000 | 261,400.00 | 0.10 |
| 3 | 600996 | 贵广网络 | 12,500 | 234,875.00 | 0.09 |
| 4 | 603986 | 兆易创新 | 982 | 174,766.54 | 0.07 |
| 5 | 603868 | 飞科电器 | 3,000 | 140,580.00 | 0.05 |

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

本基金投资的前十名证券之一生物技术

生物技术股份有限公司 关于收到中国证券监督管理委员会内蒙古监管局 行政监管措施决定书的公告 本公司及董事会全体成员保证公告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者 重大遗漏，并对其内容的真实、准确和完整承担个别及连带责任。 2016 年 12 月 1 日，金宇生物技术股份有限公司（以下简称“公司”）收到中国证券监督管理委员会内蒙古监管局（以下简称“内蒙古证监局”）《关于对 金宇生物技术股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2016] 7 号，以下简称“《决定书》”）。现将《决定书》主要内容公告如下：“近期，我局对你公司进行了现场检查，发现你公司存在如下问题： 一、公司会计估计变更未披露。根据财税[2014]75 号文件，2015 年，公司 子公司金宇保灵生物药品有限公司本期将 100 万元以下研发用固定资产折旧一 次性进费用，子公司扬州优邦生物制药有限公司对生物制药专用设备采用加速折 旧，两家子公司固定资

产折旧方法与生物股份年报披露的固定资产折旧政策不一致(公司 2015 年年报中披露的固定资产折旧方法为年限平均法), 共计影响当期 固定资产折旧金额 1,557.39 万元, 上述事项应属会计估计变更。公司未对上述 会计估计变更事项进行披露, 年报中在重要会计政策和会计估计变更中选定为不 适用。违反《上市公司信息披露管理办法》第三十条规定。二、公司财务报表列报不准确。公司 2015 年年报中, 将预付技术使用费 1,196 万元和外购用友 ERP 系统费用 268.27 万元在“在建工程”项目进行核算。合并 现金流量表时, 将销售费用中技术推广费、疫苗补偿费等的现金流出 7,375.68 万元计入“购买商品接受劳务支付的现金”。上述行为与《企业会计准则第 30 号—财务报表列报》第九条不符, 违反《上市公司信息披露管理办法》第二条规定。三、内幕信息知情人登记执行不到位。公司没有对分配股利、董事及三分之一以上监事发生变化的情况制作内幕信息知情人档案; 2015 年进行非公开发行 时未制作重大事项进程备忘录; 没有对内幕信息知情人买卖本公司股票进行自查 的相关记录, 内幕信息知情人登记制度中也没有规定进行自查的相关条款。违反《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第六条、第十条、第十二条的规定。针对上述问题, 根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条及《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第十五条的规定, 我局决定对 你公司采取责令改正的行政监管措施。你公司应当在收到本决定书之日起 30 日内向我局提交书面整改报告, 我局 将适时组织检查验收。如果对本监督管理措施不服的, 可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国 证券监督管理委员会提出行政复议申请, 也可以在收到本决定书之日起 6 个月内 向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间, 上述监督管理措施不停止执 行。” 公司董事会对上述问题高度重视, 将按照《决定书》要求在规定时间内提交 整改报告, 同时进一步规范公司治理, 并根据相关规定及时履行信息披露义务。

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 | 35,883.53 |

| | | |
|---|---------|------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 58,822.90 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,205.65 |
| 5 | 应收申购款 | 251,820.60 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 349,732.68 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

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：无。

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 | 0.07 | 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 | 218,855,609.47 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 12,013,819.70 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 21,263,021.97 |
| 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 | 209,606,407.20 |

§ 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未申购、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 4 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
2017 年 1 月 19 日