

鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF） 2017 年第 3 季度报告

2017 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：2017 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 2017 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 2017 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
前端交易代码	-
后端交易代码	-
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	199,174,534.16 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 (2017 年 7 月 1 日 — 2017 年 9 月 30 日)
1. 本期已实现收益	942,008.49
2. 本期利润	21,528,586.84
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1036
4. 期末基金资产净值	279,139,210.66
5. 期末基金份额净值	1.401

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

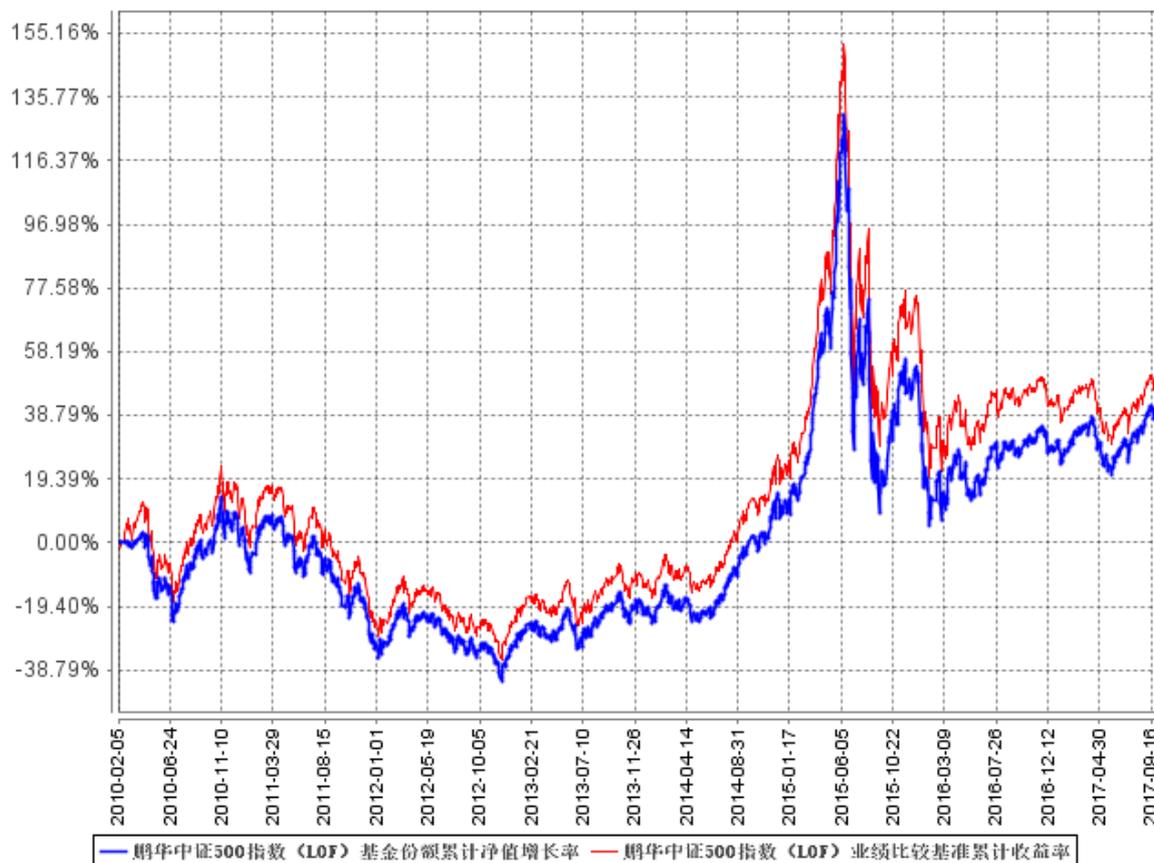
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	8.10%	0.88%	7.21%	0.89%	0.89%	-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		
张羽翔	本基金基金经理	2016 年 9 月 24 日	-	10	张羽翔先生，国籍中国，工学硕士，10 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, 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。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。
--	--	--	--	--	---

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 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 1.401 元,本报告期基金份额净值增长率为 8.10%。

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	264,032,083.02	94.22
	其中:股票	264,032,083.02	94.22
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	15,570,514.39	5.56
8	其他资产	625,334.12	0.22
9	合计	280,227,931.53	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	3,162,582.38	1.13

B	采矿业	8,870,892.42	3.18
C	制造业	165,971,695.25	59.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,270,729.73	2.96
E	建筑业	6,161,373.90	2.21
F	批发和零售业	14,107,509.78	5.05
G	交通运输、仓储和邮政业	7,032,616.65	2.52
H	住宿和餐饮业	310,860.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,609,673.30	6.31
J	金融业	3,936,175.96	1.41
K	房地产业	15,183,640.50	5.44
L	租赁和商务服务业	4,461,521.61	1.60
M	科学研究和技术服务业	723,415.60	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	2,225,760.30	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	243,551.00	0.09
Q	卫生和社会工作	514,870.80	0.18
R	文化、体育和娱乐业	2,893,928.40	1.04
S	综合	1,215,752.09	0.44
	合计	262,896,549.67	94.18

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	采矿业	39,793.60	0.01
C	制造业	802,562.71	0.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	33,357.72	0.01
F	批发和零售业	26,385.45	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.01
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	-	-
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	115,299.99	0.04
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.02
S	综合	-	-
	合计	1,135,533.35	0.41

5.2.3 报告期末按行业分类的港股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	002460	赣锋锂业	31,900	2,784,870.00	1.00
2	601012	隆基股份	72,524	2,137,282.28	0.77
3	300136	信维通信	47,600	1,999,200.00	0.72
4	600487	亨通光电	57,672	1,983,916.80	0.71
5	600516	方大炭素	62,500	1,909,375.00	0.68
6	603799	华友钴业	17,600	1,609,872.00	0.58
7	600525	长园集团	78,197	1,556,120.30	0.56
8	002340	格林美	158,515	1,372,739.90	0.49
9	002405	四维图新	53,274	1,364,879.88	0.49
10	600219	南山铝业	341,150	1,361,188.50	0.49

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	603882	金域医学	2,763	115,299.99	0.04
2	603106	恒银金融	2,786	84,025.76	0.03
3	002900	哈三联	1,983	83,087.70	0.03
4	300702	天宇股份	1,124	68,968.64	0.02
5	002899	英派斯	1,408	64,528.64	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

本组合投资的前十名证券之一格林美股份有限公司

关于公司最近五年被证券监管部门和交易所采取处罚或监管措施以及整改情况的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

格林美股份有限公司（以下简称“公司”）严格按照《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》、《深圳证券交易所股票上市规则》及《公司章程》等相关要求，不断完善公司治理结构，建立健全内部管理及控制制度，规范公司运营，提高公司治理水平，促进公司持续、健康、

稳定发展。

公司拟申请非公开发行 A 股股票，现将公司最近五年被证券监管部门和交易所处罚或采取监管措施的情况公告如下：

一、公司最近五年不存在被证券监管部门和交易所处罚的情况

二、公司最近五年被证券监管部门和交易所采取监管措施及整改或回复情况如下：

(一) 公司于 2013 年 5 月收到深交所下发的监管函。

1、监管函的内容

2013 年 5 月 17 日，深交所中小板公司管理部下发了《关于对深圳市格林美高新技术股份有限公司的监管函》(中小板监管函[2013]第 71 号)，对公司向上海证券报记者透漏尚未公开披露的重大信息行为表示关注，该行为违反了深交所《股票上市规则》(2012 年修订)第 2.8 条、2.14 条、《中小企业板上市公司规范运作指引》第 5.1.1 条、5.1.6 条的规定，提请公司董事会认真学习上述规则及指引，充分重视上述问题，吸取教训，及时整改，杜绝上述问题的再次发生。

2、整改措施

公司针对《监管函》涉及的问题，董事长、董事会秘书主动向深交所汇报了监管函提到的关于媒体报道中的表述内容，并对该业务涉及情况进行了详细说明，承诺认真整改，严格遵循信息披露的公开、公平、公正的原则，向所有投资者真实、准确、完整、及时地履行信息披露义务。同时，公司还第一时间联系该媒体记者，通报了该事项，并按照公司《投资者关系管理办法》、《机构调研接待工作管理办法》等相关制度的要求，进一步向该媒体记者强调了公司的新闻媒体采访报道流程和责任追究。公司进一步完善了机构投资者、媒体等接待流程，要求董秘、证券部相关人员全程跟踪，严格遵守信息披露的相关规定。另外，董事长召集董事、监事、高管人员以及公司的核心管理人员，认真学习《内幕信息知情人登记备案制度》、《重大事件新闻审核与发布制度》、《新闻媒体参观采访制度》、《保密制度》、《生产基地参观接待工作流程》，并指定了专人接待，对接待人员进行信息披露方面的培训，实行责任人员问责制。

(二) 公司于 2017 年 8 月收到中国证券监督管理委员会深圳监管局下发的监管关注函。

1、监管关注函的内容

2017 年 8 月 21 日，深圳证监局下发了《深圳证监局关于对格林美股份有限公司的监管关注函》(深证局公司字[2017]50 号)，对公司未在 2017 年 1 月初的 5 个交易日内披露公司 2016 年度累计新增借款占 2015 年末净资产超过 20%事项表示关注。深圳证监局考虑到公司已主动自查并采取整改措施，要求公司充分重视信息披露工作，认真学习公司债券相关法律法规，理顺债券相关信息披露流程和要求，完善内部管控机制，切实提升规范运作水平。

2、整改措施

2017 年 4 月 13 日, 根据深圳证监局《关于开展 2017 年度公司债券发行人自查工作的通知》(深证局公司字[2017]20 号)的相关要求, 公司对公司债券存续期信息披露进行全面自查, 并已按时于 2017 年 5 月 15 日提交自查报告。除上述事项以外, 公司均已按照相关规定履行信息披露义务。针对上述事项, 公司已就证监会相关法律法规、公司债券日常监管问答等关于重大事项的规定进行整改。未来债券存续期内, 为保障及时公告重大事项, 公司已指定专人在每月最后一个工作日对当月公司是否发生重大事项进行排查, 若公司发生重大事项, 公司将在重大事项发生日或当月结束之后五个工作日内公告重大事项, 对重大事项对本次债券的影响进行说明, 提醒投资者关注相关风险。

若公司当期财务数据未经审计或审计工作尚未结束, 公司将采用未经审计数据计算。

本组合投资的前十名证券之一江西赣锋锂业股份有限公司

2017 年 7 月 3 日, 深圳证券交易所中小板公司管理部下发的《关于对江西赣锋锂业股份有限公司及相关当事人的监管函》; 2017 年 7 月 6 日, 深圳证券交易所中小板公司管理部下发的《关于对江西赣锋锂业股份有限公司的监管函》

1、监管函主要内容

(1) 中小板监管函【2017】第 111 号 2016 年 10 月 25 日, 你公司披露 2016 年第三季度报告, 预计 2016 年度归属于上市公司股东的净利润 (以下简称“净利润”) 为 62,577 万元至 68,835 万元。2017 年 2 月 28 日, 公司披露业绩快报, 预计 2016 年度净利润为 45,626 万元。2017 年 4 月 12 日, 公司披露 2016 年度经审计的净利润为 46,437 万元。公司 2016 年度经审计的净利润与业绩预告中披露的净利润存在较大差异, 且未在规定期限内对业绩预告作出修正。你公司上述行为违反了深交所《股票上市规则 (2014 年修订)》第 2.1 条、第 2.5 条、第 2.7 条和第 11.3.3 条的规定。公司董事长兼总裁李良彬、副总裁兼财务总监杨满英违反了深交所《股票上市规则 (2014 年修订)》第 2.2 条和第 3.1.5 条的规定, 对公司上述违规行为负有重要责任。

(2) 中小板监管函【2017】第 115 号

你公司属于“深圳 100 指数”公司, 但未按规定在披露 2016 年度报告的同时披露社会责任报告, 直至 2017 年 7 月 4 日才对外披露《2016 年度社会责任报告》, 且社会责任报告未经公司董事会审议。

你公司的上述行为违反了本所《股票上市规则》第 1.4 条和第 2.1 条以及《中小企业板信息披露业务备忘录第 2 号: 定期报告披露相关事项》第二条第七款第一项的规定。

2、整改情况说明

(1) 加强对相关业务部门人员的培训学习

公司董事会迅速组织全体董事、监事、高级管理人员及相关业务部门的人员进行业务培训，认真学习《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所中小企业板上市公司规范运作指引》、《中小企业板信息披露业务备忘录第 1 号：业绩预告、业绩快报及其修正》、《中小企业板信息披露业务备忘录第 2 号：定期报告披露相关事项》等有关法律法规以及公司《信息披露事务管理制度》，并要求公司相关业务部门认真落实整改措施，提高公司信息披露工作水平和规范意识，保证信息披露工作制度有效执行。加强财务管理工作，强化各级会计核算工作的准确性和及时性。

(2) 加强公司与中介机构及公司各部门间的沟通

公司将加强与评估机构、会计师事务所的有效沟通，同时做好公司各部门间的沟通，更加严格把控重大事项完成的时间节点，及时发现问题、解决问题，确保重大信息的及时传递，以保证及时履行信息披露义务。

除上述情况外，公司最近五年内无其他被证券监督管理部门和交易所采取监管措施或处罚的情况。

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	37,431.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,978.21
5	应收申购款	584,924.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	625,334.12

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**5.11.6 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。

5.11.7 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

注：无。

5.11.8 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	238,953,463.03
报告期期间基金总申购份额	16,753,713.36
减：报告期期间基金总赎回份额	56,532,642.23
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	199,174,534.16

§ 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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 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) 2017 年第 3 季度报告》(原文)。

9.2 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

9.3 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 10 月 25 日