

# 鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF） 2015 年第 4 季度报告

2015 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：2016 年 1 月 21 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 1 月 18 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 2015 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	239,018,594.54 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（2015年10月1日—2015年12月31日）
1. 本期已实现收益	20,795,449.62
2. 本期利润	82,200,252.19
3. 加权平均基金份额本期利润	0.3250
4. 期末基金资产净值	357,093,075.66
5. 期末基金份额净值	1.494

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

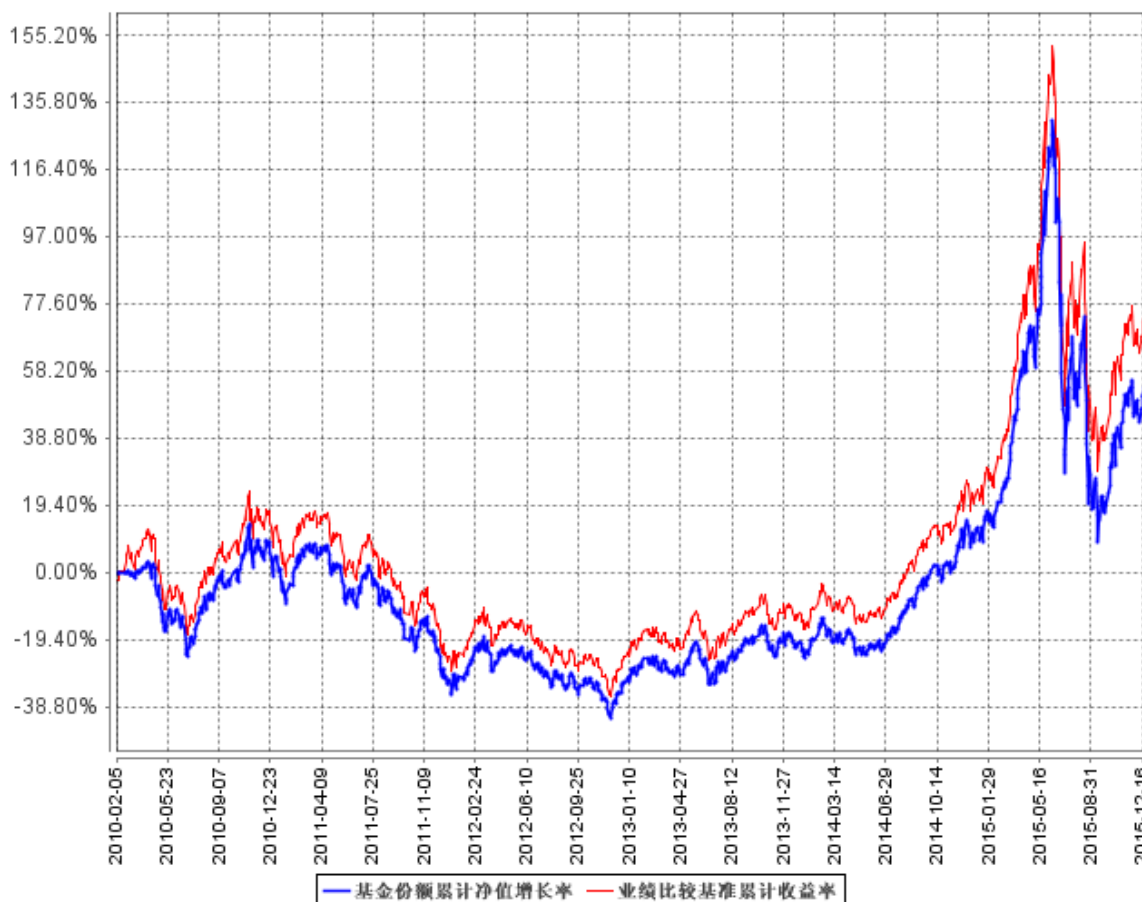
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	26.72%	2.10%	23.13%	1.94%	3.59%	0.16%

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

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。

## §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	-	17	王咏辉先生，国籍英国，工程和计算机专业硕士，17 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

					<p>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。</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 1 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

2015 年四季度中国经济在“稳增长”与“调结构”的背景下，疲弱前行，A 股市场在 3 季度呈现出异常波动后，然后在四季度市场快速恢复到 3539 点。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。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期末，本基金份额净值为 1.494 元，累计净值 1.494 元；本报告期基金份额净值增长率为+26.72%，业绩比较基准收益率+23.13%。

#### 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	333,968,251.07	93.05
	其中：股票	333,968,251.07	93.05
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	24,714,886.40	6.89
8	其他资产	216,828.79	0.06
9	合计	358,899,966.26	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	5,221,104.64	1.46
B	采矿业	10,375,661.94	2.91

C	制造业	191,144,075.55	53.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,260,296.07	2.87
E	建筑业	8,696,680.32	2.44
F	批发和零售业	23,138,967.05	6.48
G	交通运输、仓储和邮政业	8,800,281.78	2.46
H	住宿和餐饮业	614,300.40	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,492,318.31	5.74
J	金融业	4,349,574.88	1.22
K	房地产业	25,121,528.80	7.04
L	租赁和商务服务业	5,894,024.67	1.65
M	科学研究和技术服务业	1,791,694.99	0.50
N	水利、环境和公共设施管理业	2,266,256.41	0.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	883,158.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	7,992,816.21	2.24
S	综合	4,684,779.47	1.31
	合计	331,727,519.49	92.90

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	1,891,336.08	0.53
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	349,395.50	0.10
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	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,240,731.58	0.63

### 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	600880	博瑞传播	349,000	3,961,150.00	1.11
2	600289	亿阳信通	135,807	2,675,397.90	0.75
3	600816	安信信托	108,408	2,468,450.16	0.69
4	600894	广日股份	105,662	2,112,183.38	0.59
5	000718	苏宁环球	146,060	1,926,531.40	0.54
6	600635	大众公用	192,387	1,896,935.82	0.53
7	600201	生物股份	49,200	1,818,924.00	0.51
8	600435	北方导航	60,386	1,733,078.20	0.49
9	002466	天齐锂业	12,300	1,731,225.00	0.48
10	600835	上海机电	56,446	1,710,878.26	0.48

#### 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	000982	中银绒业	112,858	988,636.08	0.28
2	002018	华信国际	29,500	902,700.00	0.25
3	002091	江苏国泰	13,150	349,395.50	0.10

注：上述股票明细为本基金本报告期末持有的积极投资的全部股票。

### 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的内蒙古金宇集团股份有限公司（以下简称“公司”）第八届董事会第十五次会议及公司 2015 年第一次临时股东大会审议通过了公司非公开发行股票的相关议案。2015 年 8 月 14 日，公司收到证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）出具的《中国证监会行政许可申请受理通知书》。2015 年 11 月 23 日，公司收到中国证监会出具的《中国证监会行政许可项目审查反馈意见通知书》（152501 号）。目前，公司非公开发行正处于反馈阶段，根据反馈意见要求，现将公司最近五年来证券监管部门和交易所对公司现场检查和监管过程中发现的问题以及公司整改相关情况公告。今后，公司将严格按照《公司法》、《证券法》及中

国证监会、上海证券交易所的规范性文件和要求，不断完善公司法人治理，提高公司规范运作水平，保证公司持续、健康、稳定的发展。

2015 年 6 月 1 日，公司及董事长张翀宇、董事会秘书李树剑收到上海证券交易所上证公监函[2015]0030 号《关于对内蒙古金宇集团股份有限公司和有关责任人予以监管关注的决定》（以下简称《决定》）。内容如下：

“2014 年 10 月 12 日、10 月 30 日，内蒙古金宇集团股份有限公司（以下简称金宇集团或公司）分别召开董事会和股东大会，审议通过了关于非公开发行股票相关议案。2015 年 4 月 28 日、4 月 29 日，公司相继披露了关于终止 2014 年度非公开发行股票申请的公告及补充公告。公告中称，公司与保荐机构协商一致，决定终止本次非公开发行股票申请，并于 4 月 20 日向中国证监会提交了终止本次非公开发行的申请。4 月 24 日，公司收到中国证监会同意公司撤回申请的书面文件。

经查明，公司董事、高级管理人员已于 2015 年 4 月 17 日就终止本次非公开发行股票申请事项口头达成一致意见，但公司未履行信息披露义务。4 月 20 日，公司向中国证监会提交撤回申请，公司亦未及时履行信息披露义务，并迟至收到中国证监会的有关终止审查通知书后，才于 4 月 28 日、4 月 29 日对外披露该事项。

本次终止非公开发行股票事宜，属于对公司股价可能产生较大影响的重大事件，且终止非公开发行股票的进程中，公司股票一直处于交易状态，公司应当严格按照《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称“《股票上市规则》”）的规定，及时履行信息披露义务。金宇集团未及时披露该信息，违反了《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称“《股票上市规则》”）第 2.1 条、第 2.3 条、第 7.3 条、第 7.5 条等有关规定。董事长张翀宇作为公司信息披露义务第一责任人，董事会秘书李树剑作为公司信息披露事务直接负责人，均未做到勤勉尽责，对公司的违规行为负有主要责任，违反了《股票上市规则》第 2.2 条、第 3.1.4 条、第 3.1.5 条、第 3.2.2 条的规定以及在《董事（监事、高级管理人员）声明及承诺书》中做出的承诺。

鉴于上述事实 and 情节，根据《股票上市规则》第 17.1 条和《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》的有关规定，我部做出如下监管措施决定：

对内蒙古金宇集团股份有限公司和董事长张翀宇、董事会秘书李树剑予以监管关注。

公司应当引以为戒，严格按照法律、法规和《股票上市规则》的规定，规范运作，认真履行信息披露义务；董事、高级管理人员应当履行忠实勤勉义务，促使公司规范运作，并保证公司及时、公平、真实、准确和完整地披露所有重大信息。”

收到上述《决定》后，公司董事长、董事会秘书及相关工作人员进行了认真反思，查找原因，

引以为戒。公司董事、监事、高级管理人员认真学习和领会《公司法》、《证券法》、《股票上市规则》等规范性文件，加强对自身职责和相关规章制度的理解和认识，认真履行勤勉尽责义务，依法规范运作，严格按照《股票上市规则》的规定及时履行信息披露义务，防范和杜绝类似事件的发生。

对该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。

### 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	117,159.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,936.36
5	应收申购款	95,732.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	216,828.79

### 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 报告期末指数投资前十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	600880	博瑞传播	3,961,150.00	1.11	重大事项

**5.11.6 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	000982	中银绒业	988,636.08	2.80	重大事项
2	002018	华信国际	902,700.00	2.50	重大事项

**5.11.7 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	263,657,511.23
报告期期间基金总申购份额	28,977,018.02
减：报告期期间基金总赎回份额	53,615,934.71
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	239,018,594.54

**§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) 2015 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  
2016 年 1 月 21 日