

鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资 基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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.....	9
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.....	10
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.....	12
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.....	12
§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	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
7.7 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.....	43
7.8 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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	50
§11 备查文件目录.....	51
11.1 备查文件目录.....	51
11.2 存放地点.....	51
11.3 查阅方式.....	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	鹏华沪深 300ETF
场内简称	A300ETF
基金主代码	159927
基金交易代码	159927
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 7 月 19 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,192,168.00 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	2013-08-16

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法，按照成份股在标的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或成份股发生配股、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	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	田青
	联系电话	0755-82825720	010-67595096
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	010-67595096
传真		0755-82021126	010-66275853
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	北京市西城区金融街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		何如	王洪章

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43层鹏华基金管理有限公司 北京市西城区金融大街25号中国建设银行股份有限公司

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	-516,264.80
本期利润	-7,861,986.00
加权平均基金份额本期利润	-0.8386
本期加权平均净值利润率	-26.76%
本期基金份额净值增长率	-15.86%
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	7,298,726.43
期末可供分配基金份额利润	0.8909
期末基金资产净值	25,811,163.70
期末基金份额净值	3.1507
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	39.43%

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，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	-0.27%	0.94%	-0.49%	0.98%	0.22%	-0.04%
过去三个月	-1.77%	0.99%	-1.99%	1.01%	0.22%	-0.02%
过去六个月	-15.86%	1.83%	-15.47%	1.84%	-0.39%	-0.01%
过去一年	-30.24%	2.28%	-29.49%	2.30%	-0.75%	-0.02%
自基金合同生效起至今	39.43%	1.82%	40.47%	1.84%	-1.04%	-0.02%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数

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300ETF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 2013 年 7 月 19 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		
崔俊杰	本基金基金经理	2013 年 7 月 19 日	-	8	崔俊杰先生，国籍中国，管理学硕士，8 年证券从业经验。2008 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任产品规划部产品设计师、量化投资部量化研究员，先后从事产品设计、量化研究工作，2013 年 3 月起担任鹏华深证民营 ETF 基金及其联接基金基金经理，2013 年 3 月起兼任鹏华上证民企 50ETF 基金及其联接基金基金经理，2013 年 7 月起兼任鹏华沪深 300ETF 基金基金经理，2014 年 12 月起兼任鹏华资源分级基金基金经理，2014 年 12 月起兼任鹏华传媒分级基金基金经理，2015 年 4 月起兼任鹏华银行分级基金基金经理，2015 年 8 月至 2016 年 7 月兼任鹏华医药分级（2016 年 7 月已转型为鹏华中证医药卫生（LOF））基金基金经理，2016 年 7 月起兼任鹏华中证医药卫生（LOF）基金基金经理。崔俊杰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 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，整个 A 股市场呈现震荡走势，先抑后扬，波动率和成交量环比降低。本基金秉承指数基金的投资策略，在应对申购赎回的基础上，力争跟踪指数收益，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

2016 年上半年，本基金申购赎回较为频繁，对基金的管理运作带来一定影响，面临这种情况，我们进行了精心的管理，较好的实现了跟踪误差控制目标。

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 3.1507 元，累计净值 1.3943 元；本报告期基金份额净值增长率为-15.86%。

本报告期基金日均跟踪偏离度的绝对值 0.004%，年化跟踪误差 0.631%。

对本基金而言，报告期内跟踪误差的主要来源为：样本股特殊事件导致的停复牌、成分股调整以及为应对申购赎回必要的现金留存等，对此我们采取了进一步的优化策略进行应对。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体来看，2016 年以来，虽然经济总量增速下调已是既定事实，但刺激政策频发，深化国企改革，一带一路稳步推进，房地产松绑政策推出，稳保就业底线，汇率风险逐渐释放等已经逐渐得到大家的接受和认可。本质来讲，调结构与稳增长很难并行，若不破旧立新，经济结构的调整很难到位。促进改革、稳定增长和防范风险三者涵盖了中国经济的短期和长期、速度和效益之间的辩证关系，我们不可能只要长期不要短期，只要效益不要速度，因此我们预期在经济增长相对稳定之中，加快推动结构的调整，随着改革红利逐步释放，生产效率的逐渐提升，势必能改变经济潜在下沉的局面。

2016 年宏观经济面临的问题较多，诸如货币政策的松紧，人民币汇率，房地产去库存如何执行，经济增速趋缓的刺激政策，注册制和退市制的推出，深港通的推出，美元加息，资产荒等。这些问题及衍生的新问题的出现和解决将决定未来 A 股市场的走势，也许随着人民币汇率的企稳，大类资产配置或许会逐步向股市转移，房地产去库存有效执行，银行坏账率持续降低，A 股市场整体估值将可能在未来一段时间平稳提升。但在市场波动中尤其要注意参与力度和风险控制，因此，我们建议继续密切关注与实体经济相关的宏观数据变化和政策信息。

我们仍然强调前期的观点：反复的经济形势势必带来资产之间轮动演绎的复杂化和高频率化，资产配置犯错的概率和机会成本相对较高，建议投资者从中长期投资的角度来考虑战略资产配置，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，力争为投资者带来较好的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

(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会计核算岗外，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。

(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。

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。

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. 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

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 7,298,726.43 元，期末基金份额净值 3.1507 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，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

本报告期内，本基金出现过连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形；截至报告期末，本基金资产净值仍低于五千万元。

§ 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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 交易型开放式指数证券投资基金

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	686,252.36	606,744.51
结算备付金		3,930.46	-
存出保证金		914.93	1,222.68
交易性金融资产	6.4.7.2	25,588,709.97	38,039,706.19
其中：股票投资		25,588,709.97	38,039,706.19
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	141.58	113.14
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		26,279,949.30	38,647,786.52
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		-	18.43
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,507.46	16,203.63
应付托管费		2,101.49	3,240.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,786.37	5,241.19
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	451,390.28	455,000.00
负债合计		468,785.60	479,703.97
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	18,512,437.27	23,031,982.57
未分配利润	6.4.7.10	7,298,726.43	15,136,099.98
所有者权益合计		25,811,163.70	38,168,082.55
负债和所有者权益总计		26,279,949.30	38,647,786.52

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.1507 元，基金份额总额 8,192,168.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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		-7,461,294.62	20,497,922.81
1.利息收入		2,587.92	2,233.72
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,586.96	2,227.97
债券利息收入		0.96	5.75
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）		-104,127.46	28,426,777.21
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-341,525.32	27,978,444.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	409.04	14,426.25
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	236,988.82	433,906.21
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-7,345,721.20	-7,931,088.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-14,033.88	-
减：二、费用		400,691.38	555,078.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	72,828.45	185,367.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	14,565.70	37,073.45
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	11,611.95	29,103.99
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	301,685.28	303,533.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,861,986.00	19,942,844.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,861,986.00	19,942,844.64

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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）	23,031,982.57	15,136,099.98	38,168,082.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,861,986.00	-7,861,986.00
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）	-4,519,545.30	24,612.45	-4,494,932.85
其中：1. 基金申购款	36,156,362.54	16,611,293.96	52,767,656.50
2. 基金赎回款	-40,675,907.84	-16,586,681.51	-57,262,589.35
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）	18,512,437.27	7,298,726.43	25,811,163.70
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）	54,668,799.76	31,757,641.61	86,426,441.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,942,844.64	19,942,844.64
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）	-27,117,271.88	-24,187,037.53	-51,304,309.41
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-27,117,271.88	-24,187,037.53	-51,304,309.41
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）	27,551,527.88	27,513,448.72	55,064,976.60

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：

<u> 邓召明 </u>	<u> 高鹏 </u>	<u> 郝文高 </u>
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 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2013]第 640 号《关于核准鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准，由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 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,306,495,157.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字(2013)第 380 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 7 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,306,582,851.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 87,694.00 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司确

定 2013 年 8 月 8 日为本基金的基金份额折算日。当日沪深 300 指数收盘值为 2,276.782 点,本基金资产净值为 1,316,433,799.64 元,折算前基金份额总额为 1,306,582,851.00 份,折算前基金份额净值为 1.0075 元。根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为 0.44252786,折算后基金份额总额为 578,192,168.00 份,折算后基金份额净值为 2.2768 元。本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司已根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,并由本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2013 年 8 月 9 日进行了变更登记。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上【2013】266 号文审核同意,本基金 578,192,168.00 份基金份额于 2013 年 8 月 16 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的标的指数为沪深 300 指数,投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化;主要投资范围为标的指数成份股及其备选成份股(投资比例不低于基金资产净值的 95%)。此外,为更好的实现投资目标,本基金将少量投资于非标的指数成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、新股(首次发行或增发等)、金融衍生产品(权证、股指期货等)、债券及法律法规和中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数。

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 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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 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 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

本基金本报告期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	686,252.36
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-

其他存款	-
合计:	686,252.36

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	25,485,066.46	25,588,709.97	103,643.51
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	25,485,066.46	25,588,709.97	103,643.51

注：股票投资项含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

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：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

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	139.27
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	1.81
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	0.50
合计	141.58

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：无。

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	4,786.37
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,786.37

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	-
预提费用	401,390.28
指数使用费	50,000.00
合计	451,390.28

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	10,192,168.00	23,031,982.57
本期申购	16,000,000.00	36,156,362.54
本期赎回(以“-”号填列)	-18,000,000.00	-40,675,907.84
本期末	8,192,168.00	18,512,437.27

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

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	30,412,938.88	-15,276,838.90	15,136,099.98
本期利润	-516,264.80	-7,345,721.20	-7,861,986.00
本期基金份额交易产生的变动数	-5,933,350.13	5,957,962.58	24,612.45
其中：基金申购款	47,087,869.89	-30,476,575.93	16,611,293.96
基金赎回款	-53,021,220.02	36,434,538.51	-16,586,681.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,963,323.95	-16,664,597.52	7,298,726.43

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	2,292.47
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	284.63
其他	9.86
合计	2,586.96

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-62,703.79
股票投资收益——赎回差价收入	-278,821.53
合计	-341,525.32

6.4.7.12.2 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	4,192,772.21
减：卖出股票成本总额	4,255,476.00

买卖股票差价收入	-62,703.79
----------	------------

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
赎回基金份额对价总额	57,262,589.35
减：现金支付赎回款总额	4,448,883.35
减：赎回股票成本总额	53,092,527.53
赎回差价收入	-278,821.53

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	409.04
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	409.04

6.4.7.13.2 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	2,410.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,000.00
减：应收利息总额	0.96
买卖债券差价收入	409.04

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

6.4.7.16 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	236,988.82
基金投资产生的股利收益	-
合计	236,988.82

6.4.7.17 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	-7,345,721.20
——股票投资	-7,345,721.20
——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	-7,345,721.20

6.4.7.18 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	-
替代损益	-14,033.88
合计	-14,033.88

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.19 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	11,611.95
银行间市场交易费用	-
合计	11,611.95

6.4.7.20 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	22,376.90
信息披露费	149,178.12
上市年费	29,835.26
指数使用费	100,000.00
银行汇划费用	295.00
合计	301,685.28

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

中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、基金的一级交易商

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

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

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	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
当期发生的基金应支付的管理费	72,828.45	185,367.05

注：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0.5%，逐日计提，按月支付。

日管理费=前一日基金资产净值×0.5%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付	14,565.70	37,073.45

的托管费		
------	--	--

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费年费率为 0.1%，逐日计提，按月支付。

日托管费=前一日基金资产净值×0.1%÷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：无。

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，本基金管理人未投资、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
中国建设银行	686,252.36	2,292.47	532,876.46	2,129.87

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没有参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

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

注：无。

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	24.43	2016年7月4日	21.99	30,140	335,846.00	736,320.20	-
000651	格力电器	2016年2月22日	重大事项	19.22	-	-	18,658	311,907.54	358,606.76	-
002065	东华软件	2015年12月22日	重大事项	25.10	2016年7月4日	22.59	3,000	54,617.48	75,300.00	-
600019	宝钢股份	2016年6月27日	重大事项	4.90	-	-	14,900	79,164.34	73,010.00	-
600649	城投控股	2016年6月20日	重大事项	14.36	-	-	4,440	66,900.96	63,758.40	-
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	3,579	63,633.32	59,840.88	-
002465	海格通信	2016年6月13日	重大事项	12.44	-	-	4,500	55,309.42	55,980.00	-
000415	渤海金控	2016年2月1日	重大事项	6.82	2016年8月11日	7.50	7,200	58,950.57	49,104.00	-
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事项	8.29	-	-	4,080	40,772.36	33,823.20	-
600005	武钢股份	2016年6月27日	重大事项	2.76	-	-	12,100	47,255.47	33,396.00	-
000629	*ST钒钛	2016年5月26日	重大事项	2.39	-	-	13,103	41,332.00	31,316.17	-

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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，将风险控制在可承受的范围之内。

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建设银行股份有限公司，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：未持有）。

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同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为银行存款、结算备付金及部分应收申购款，其余金融资产和金融负债均不计息，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	686,252.36	-	-	-	686,252.36
结算备付金	3,930.46	-	-	-	3,930.46
存出保证金	914.93	-	-	-	914.93
交易性金融资产	-	-	-	-25,588,709.97	25,588,709.97
应收利息	-	-	-	141.58	141.58
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	691,097.75	-	-	-25,588,851.55	26,279,949.30
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	10,507.46	10,507.46
应付托管费	-	-	-	2,101.49	2,101.49
应付交易费用	-	-	-	4,786.37	4,786.37
其他负债	-	-	-	451,390.28	451,390.28
负债总计	-	-	-	468,785.60	468,785.60
利率敏感度缺口	691,097.75	-	-	-25,120,065.95	25,811,163.70
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	606,744.51	-	-	-	606,744.51
存出保证金	1,222.68	-	-	-	1,222.68
交易性金融资产	-	-	-	-38,039,706.19	38,039,706.19
应收利息	-	-	-	113.14	113.14
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	607,967.19	-	-	-38,039,819.33	38,647,786.52
负债					
应付证券清算款	-	-	-	18.43	18.43
应付管理人报酬	-	-	-	16,203.63	16,203.63
应付托管费	-	-	-	3,240.72	3,240.72
应付交易费用	-	-	-	5,241.19	5,241.19
其他负债	-	-	-	455,000.00	455,000.00
负债总计	-	-	-	479,703.97	479,703.97
利率敏感度缺口	607,967.19	-	-	-37,560,115.36	38,168,082.55

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：未持有）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	25,588,709.97	99.14	38,039,706.19	99.66
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	25,588,709.97	99.14	38,039,706.19	99.66

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%	1,280,240.39	1,921,461.73
	业绩比较基准下降5%	-1,280,240.39	-1,921,461.73

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	25,588,709.97	97.37
	其中：股票	25,588,709.97	97.37
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	690,182.82	2.63
7	其他各项资产	1,056.51	0.00
8	合计	26,279,949.30	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2.1 的合计项不含可退替代款估值增值。

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	19,676.80	0.08
B	采矿业	919,268.22	3.56
C	制造业	8,043,390.32	31.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	998,895.65	3.87
E	建筑业	832,740.62	3.23
F	批发和零售业	547,044.26	2.12
G	交通运输、仓储和邮政业	770,727.91	2.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,593,944.07	6.18
J	金融业	9,172,840.07	35.54
K	房地产业	1,582,725.60	6.13
L	租赁和商务服务业	305,209.05	1.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	175,774.82	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	42,009.50	0.16
R	文化、体育和娱乐业	462,160.08	1.79
S	综合	122,303.00	0.47
	合计	25,588,709.97	99.14

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：无。

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	32,482	1,040,723.28	4.03
2	000002	万科A	30,140	736,320.20	2.85
3	600016	民生银行	71,360	637,244.80	2.47

4	601166	兴业银行	40,120	611,428.80	2.37
5	600036	招商银行	30,899	540,732.50	2.09
6	601328	交通银行	81,940	461,322.20	1.79
7	600519	贵州茅台	1,421	414,818.32	1.61
8	600000	浦发银行	26,026	405,224.82	1.57
9	600030	中信证券	23,680	384,326.40	1.49
10	600837	海通证券	24,389	376,078.38	1.46
11	601288	农业银行	115,440	369,408.00	1.43
12	000651	格力电器	18,658	358,606.76	1.39
13	601398	工商银行	72,580	322,255.20	1.25
14	601169	北京银行	30,578	317,093.86	1.23
15	600887	伊利股份	18,302	305,094.34	1.18
16	601601	中国太保	9,420	254,716.80	0.99
17	601766	中国中车	27,676	253,788.92	0.98
18	600900	长江电力	19,501	243,567.49	0.94
19	601668	中国建筑	45,220	240,570.40	0.93
20	000333	美的集团	9,605	227,830.60	0.88
21	601988	中国银行	63,607	204,178.47	0.79
22	600104	上汽集团	9,960	202,088.40	0.78
23	601688	华泰证券	9,840	186,172.80	0.72
24	000858	五粮液	5,680	184,770.40	0.72
25	601818	光大银行	48,040	180,630.40	0.70
26	000001	平安银行	20,690	180,003.00	0.70
27	601989	中国重工	27,700	175,341.00	0.68
28	600048	保利地产	19,447	167,827.61	0.65
29	600276	恒瑞医药	4,168	167,178.48	0.65
30	000725	京东方 A	71,780	165,811.80	0.64
31	600015	华夏银行	16,056	158,793.84	0.62
32	600028	中国石化	31,723	149,732.56	0.58
33	000776	广发证券	8,855	148,409.80	0.57
34	300104	乐视网	2,800	148,148.00	0.57
35	600999	招商证券	8,680	143,220.00	0.55
36	600518	康美药业	9,280	140,963.20	0.55
37	300059	东方财富	6,320	140,304.00	0.54
38	002450	康得新	7,664	131,054.40	0.51
39	600958	东方证券	7,500	126,075.00	0.49
40	002736	国信证券	7,100	122,475.00	0.47
41	002024	苏宁云商	11,235	122,012.10	0.47
42	601390	中国中铁	16,822	117,249.34	0.45

43	002415	海康威视	5,450	116,957.00	0.45
44	000783	长江证券	10,020	116,232.00	0.45
45	601006	大秦铁路	17,920	115,404.80	0.45
46	002304	洋河股份	1,600	115,072.00	0.45
47	000166	申万宏源	13,422	112,879.02	0.44
48	601939	建设银行	22,840	108,490.00	0.42
49	002594	比亚迪	1,740	106,157.40	0.41
50	601857	中国石油	14,623	105,724.29	0.41
51	002673	西部证券	4,060	104,991.60	0.41
52	601377	兴业证券	14,156	104,612.84	0.41
53	002739	万达院线	1,300	103,870.00	0.40
54	601186	中国铁建	10,324	102,827.04	0.40
55	600795	国电电力	35,020	102,608.60	0.40
56	601628	中国人寿	4,920	102,434.40	0.40
57	601009	南京银行	10,908	102,426.12	0.40
58	000063	中兴通讯	7,084	101,584.56	0.39
59	001979	招商蛇口	7,063	100,647.75	0.39
60	000538	云南白药	1,537	98,829.10	0.38
61	600050	中国联通	25,601	97,539.81	0.38
62	600637	东方明珠	4,004	97,177.08	0.38
63	601899	紫金矿业	28,632	96,489.84	0.37
64	601985	中国核电	14,100	96,303.00	0.37
65	601901	方正证券	12,400	94,984.00	0.37
66	600011	华能国际	12,620	94,902.40	0.37
67	601336	新华保险	2,320	93,728.00	0.36
68	600570	恒生电子	1,400	93,478.00	0.36
69	000625	长安汽车	6,780	92,682.60	0.36
70	300017	网宿科技	1,299	87,292.80	0.34
71	002230	科大讯飞	2,655	87,216.75	0.34
72	600111	北方稀土	6,521	86,794.51	0.34
73	600585	海螺水泥	5,960	86,658.40	0.34
74	002142	宁波银行	5,856	86,551.68	0.34
75	601555	东吴证券	6,320	84,688.00	0.33
76	000503	海虹控股	2,100	84,441.00	0.33
77	600010	包钢股份	29,418	84,135.48	0.33
78	601099	太平洋	13,710	84,042.30	0.33
79	601088	中国神华	5,925	83,364.75	0.32
80	300024	机器人	3,280	83,279.20	0.32
81	600547	山东黄金	2,140	83,267.40	0.32

82	000423	东阿阿胶	1,562	82,520.46	0.32
83	601211	国泰君安	4,600	81,834.00	0.32
84	600153	建发股份	6,814	81,768.00	0.32
85	600690	青岛海尔	9,200	81,696.00	0.32
86	600893	中航动力	2,340	81,081.00	0.31
87	600100	同方股份	5,340	79,886.40	0.31
88	600271	航天信息	3,340	79,492.00	0.31
89	300027	华谊兄弟	5,852	79,236.08	0.31
90	600066	宇通客车	4,000	79,200.00	0.31
91	002241	歌尔股份	2,671	76,604.28	0.30
92	600705	中航资本	13,000	76,440.00	0.30
93	002065	东华软件	3,000	75,300.00	0.29
94	600009	上海机场	2,870	74,763.50	0.29
95	600029	南方航空	10,585	74,730.10	0.29
96	600703	三安光电	3,705	73,988.85	0.29
97	600109	国金证券	5,470	73,735.60	0.29
98	600019	宝钢股份	14,900	73,010.00	0.28
99	000100	TCL 集团	22,080	72,643.20	0.28
100	601669	中国电建	12,440	71,032.40	0.28
101	002202	金风科技	4,680	70,808.40	0.27
102	600383	金地集团	6,794	70,385.84	0.27
103	601198	东兴证券	2,800	68,432.00	0.27
104	600886	国投电力	10,220	67,452.00	0.26
105	601727	上海电气	8,900	67,284.00	0.26
106	600115	东方航空	10,174	67,250.14	0.26
107	600535	天士力	1,878	67,157.28	0.26
108	300070	碧水源	4,489	66,796.32	0.26
109	600089	特变电工	7,745	65,987.40	0.26
110	000768	中航飞机	3,340	65,764.60	0.25
111	000839	中信国安	3,000	63,930.00	0.25
112	600649	城投控股	4,440	63,758.40	0.25
113	600177	雅戈尔	4,620	63,709.80	0.25
114	600196	复星医药	3,340	63,526.80	0.25
115	000009	中国宝安	4,630	63,431.00	0.25
116	600340	华夏幸福	2,600	63,388.00	0.25
117	000069	华侨城 A	9,820	62,848.00	0.24
118	600485	信威集团	3,500	62,440.00	0.24
119	000568	泸州老窖	2,100	62,370.00	0.24
120	601600	中国铝业	16,506	62,227.62	0.24

121	601607	上海医药	3,440	62,092.00	0.24
122	000895	双汇发展	2,970	62,013.60	0.24
123	002456	欧菲光	2,100	61,950.00	0.24
124	600369	西南证券	8,440	61,274.40	0.24
125	600804	鹏博士	3,360	61,252.80	0.24
126	002252	上海莱士	1,600	60,288.00	0.23
127	600023	浙能电力	11,840	60,265.60	0.23
128	000728	国元证券	3,579	59,840.88	0.23
129	600118	中国卫星	1,780	59,808.00	0.23
130	300315	掌趣科技	5,700	59,793.00	0.23
131	601888	中国国旅	1,350	59,373.00	0.23
132	601788	光大证券	3,500	59,290.00	0.23
133	000793	华闻传媒	6,000	59,280.00	0.23
134	600867	通化东宝	2,856	59,090.64	0.23
135	600352	浙江龙盛	6,820	58,788.40	0.23
136	600489	中金黄金	5,196	58,403.04	0.23
137	600660	福耀玻璃	4,160	58,240.00	0.23
138	600406	国电南瑞	4,315	57,691.55	0.22
139	601919	中国远洋	11,300	57,404.00	0.22
140	600031	三一重工	11,414	57,298.28	0.22
141	300168	万达信息	2,200	57,178.00	0.22
142	601018	宁波港	11,545	57,147.75	0.22
143	002008	大族激光	2,500	57,100.00	0.22
144	600221	海南航空	17,800	56,426.00	0.22
145	000338	潍柴动力	7,220	56,388.20	0.22
146	002236	大华股份	4,300	56,330.00	0.22
147	000917	电广传媒	3,400	56,202.00	0.22
148	600739	辽宁成大	3,600	56,052.00	0.22
149	002465	海格通信	4,500	55,980.00	0.22
150	600208	新湖中宝	13,200	55,836.00	0.22
151	600309	万华化学	3,180	55,014.00	0.21
152	000157	中联重科	13,199	54,511.87	0.21
153	000686	东北证券	4,220	54,480.20	0.21
154	600674	川投能源	6,566	54,235.16	0.21
155	601618	中国中冶	14,633	53,995.77	0.21
156	000623	吉林敖东	2,157	53,817.15	0.21
157	002500	山西证券	3,240	53,654.40	0.21
158	600061	国投安信	3,000	53,460.00	0.21
159	000559	万向钱潮	3,380	52,728.00	0.20

160	601998	中信银行	9,220	52,277.40	0.20
161	600741	华域汽车	3,720	52,117.20	0.20
162	600718	东软集团	2,840	52,028.80	0.20
163	601111	中国国航	7,680	51,916.80	0.20
164	000876	新希望	6,200	51,584.00	0.20
165	600415	小商品城	8,210	50,737.80	0.20
166	601933	永辉超市	12,220	50,468.60	0.20
167	000540	中天城投	8,100	50,463.00	0.20
168	300124	汇川技术	2,600	50,440.00	0.20
169	002475	立讯精密	2,550	50,107.50	0.19
170	600018	上港集团	9,700	49,470.00	0.19
171	000630	铜陵有色	19,425	49,339.50	0.19
172	002385	大北农	6,100	49,166.00	0.19
173	600663	陆家嘴	2,160	49,140.00	0.19
174	000415	渤海金控	7,200	49,104.00	0.19
175	600839	四川长虹	11,056	48,867.52	0.19
176	600085	同仁堂	1,640	48,855.60	0.19
177	002183	怡亚通	3,400	48,688.00	0.19
178	600068	葛洲坝	8,275	48,160.50	0.19
179	601800	中国交建	4,540	47,806.20	0.19
180	000060	中金岭南	4,577	47,738.11	0.18
181	000046	泛海控股	4,700	47,517.00	0.18
182	300003	乐普医疗	2,600	47,424.00	0.18
183	603993	洛阳钼业	11,351	47,106.65	0.18
184	600446	金证股份	1,300	46,735.00	0.18
185	002081	金螳螂	4,661	46,703.22	0.18
186	000826	启迪桑德	1,510	46,130.50	0.18
187	600583	海油工程	6,640	45,882.40	0.18
188	000750	国海证券	6,192	45,758.88	0.18
189	600398	海澜之家	4,000	45,200.00	0.18
190	000963	华东医药	668	45,023.20	0.17
191	002292	奥飞娱乐	1,500	44,925.00	0.17
192	000413	东旭光电	5,200	44,668.00	0.17
193	600150	中国船舶	1,991	44,319.66	0.17
194	600157	永泰能源	11,109	43,769.46	0.17
195	000402	金融街	4,480	43,545.60	0.17
196	000792	盐湖股份	2,060	43,466.00	0.17
197	002007	华兰生物	1,375	43,175.00	0.17
198	300144	宋城演艺	1,700	42,347.00	0.16

199	300015	爱尔眼科	1,150	42,009.50	0.16
200	600895	张江高科	2,300	41,584.00	0.16
201	600060	海信电器	2,340	41,371.20	0.16
202	002152	广电运通	2,500	41,100.00	0.16
203	300058	蓝色光标	4,195	40,733.45	0.16
204	601106	中国一重	7,800	40,638.00	0.16
205	600588	用友网络	2,056	40,256.48	0.16
206	601333	广深铁路	10,182	39,811.62	0.15
207	600688	上海石化	6,500	39,650.00	0.15
208	600820	隧道股份	4,700	39,433.00	0.15
209	002422	科伦药业	2,558	39,418.78	0.15
210	000425	徐工机械	12,756	39,033.36	0.15
211	600642	申能股份	6,780	38,917.20	0.15
212	600816	安信信托	2,300	38,801.00	0.15
213	600256	广汇能源	9,460	38,786.00	0.15
214	601098	中南传媒	2,140	38,755.40	0.15
215	300002	神州泰岳	3,600	38,304.00	0.15
216	600332	白云山	1,540	37,945.60	0.15
217	601866	中海集运	9,520	37,699.20	0.15
218	000977	浪潮信息	1,600	37,520.00	0.15
219	002470	金正大	4,600	37,030.00	0.14
220	601258	庞大集团	13,300	36,575.00	0.14
221	600027	华电国际	7,380	36,531.00	0.14
222	600252	中恒集团	8,325	36,130.50	0.14
223	600074	保千里	2,400	35,808.00	0.14
224	000709	河钢股份	12,812	35,489.24	0.14
225	600875	东方电气	3,596	35,312.72	0.14
226	601718	际华集团	4,600	35,144.00	0.14
227	601991	大唐发电	9,000	35,010.00	0.14
228	600873	梅花生物	5,620	34,900.20	0.14
229	000738	中航动控	1,300	34,320.00	0.13
230	002129	中环股份	4,080	33,823.20	0.13
231	600005	武钢股份	12,100	33,396.00	0.13
232	600376	首开股份	3,000	33,360.00	0.13
233	600362	江西铜业	2,470	33,295.60	0.13
234	600373	中文传媒	1,600	33,200.00	0.13
235	601117	中国化学	5,940	32,848.20	0.13
236	600170	上海建工	8,385	32,114.55	0.12
237	300133	华策影视	2,060	32,074.20	0.12

238	000729	燕京啤酒	4,180	31,726.20	0.12
239	000629	*ST 钒钛	13,103	31,316.17	0.12
240	600737	中粮屯河	2,700	31,185.00	0.12
241	601225	陕西煤业	6,000	31,020.00	0.12
242	600372	中航电子	1,590	30,957.30	0.12
243	601179	中国西电	6,100	30,927.00	0.12
244	000778	新兴铸管	6,566	30,466.24	0.12
245	601633	长城汽车	3,600	30,384.00	0.12
246	000061	农产品	2,480	30,156.80	0.12
247	601872	招商轮船	6,400	29,952.00	0.12
248	000039	中集集团	2,097	29,714.49	0.12
249	300251	光线传媒	2,560	29,593.60	0.11
250	600037	歌华有线	1,900	28,899.00	0.11
251	601021	春秋航空	600	28,764.00	0.11
252	601992	金隅股份	3,700	28,675.00	0.11
253	601216	君正集团	3,820	28,535.40	0.11
254	601898	中煤能源	5,434	28,039.44	0.11
255	600704	物产中大	2,990	27,986.40	0.11
256	600827	百联股份	2,287	27,626.96	0.11
257	600008	首创股份	7,000	27,230.00	0.11
258	300146	汤臣倍健	2,000	27,080.00	0.10
259	002195	二三四五	2,200	27,038.00	0.10
260	000712	锦龙股份	1,300	26,988.00	0.10
261	000883	湖北能源	5,800	26,854.00	0.10
262	000999	华润三九	1,100	26,642.00	0.10
263	603000	人民网	1,600	26,576.00	0.10
264	002027	分众传媒	1,600	26,416.00	0.10
265	600863	内蒙华电	8,710	26,304.20	0.10
266	002146	荣盛发展	3,870	26,006.40	0.10
267	000800	一汽轿车	2,360	25,676.80	0.10
268	600021	上海电力	2,500	25,675.00	0.10
269	600959	江苏有线	1,800	25,128.00	0.10
270	600038	中直股份	600	24,888.00	0.10
271	002294	信立泰	880	23,936.00	0.09
272	601928	凤凰传媒	2,220	23,398.80	0.09
273	601958	金钼股份	2,869	23,382.35	0.09
274	000027	深圳能源	3,500	22,330.00	0.09
275	600600	青岛啤酒	750	21,802.50	0.08
276	600648	外高桥	1,100	21,681.00	0.08

277	601808	中海油服	1,783	21,663.45	0.08
278	002153	石基信息	800	21,104.00	0.08
279	000898	鞍钢股份	5,500	21,065.00	0.08
280	601608	中信重工	3,900	20,943.00	0.08
281	300085	银之杰	700	20,930.00	0.08
282	000825	太钢不锈	6,600	20,856.00	0.08
283	600582	天地科技	4,600	20,700.00	0.08
284	000156	华数传媒	1,100	20,405.00	0.08
285	601118	海南橡胶	3,520	19,676.80	0.08
286	600317	营口港	5,800	19,488.00	0.08
287	002424	贵州百灵	1,100	18,920.00	0.07
288	600871	石化油服	4,900	18,816.00	0.07
289	600578	京能电力	4,100	17,548.00	0.07
290	600666	奥瑞德	500	17,380.00	0.07
291	600783	鲁信创投	800	17,288.00	0.07
292	600098	广州发展	2,200	17,204.00	0.07
293	002399	海普瑞	960	16,761.60	0.06
294	600998	九州通	900	15,759.00	0.06
295	600685	中船防务	600	15,216.00	0.06
296	600188	兖州煤业	1,143	12,504.42	0.05
297	600022	山东钢铁	4,600	10,902.00	0.04
298	600606	绿地控股	1,000	10,820.00	0.04
299	603885	吉祥航空	400	10,500.00	0.04
300	002568	百润股份	400	8,800.00	0.03
301	601016	节能风电	600	5,958.00	0.02

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

注：无。

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	600016	民生银行	454,567.00	1.19
2	300027	华谊兄弟	412,698.11	1.08

3	000063	中兴通讯	132,840.00	0.35
4	600036	招商银行	91,452.00	0.24
5	000009	中国宝安	84,227.00	0.22
6	600958	东方证券	74,463.00	0.20
7	002739	万达院线	66,560.00	0.17
8	601328	交通银行	59,508.00	0.16
9	601318	中国平安	57,591.00	0.15
10	000839	中信国安	55,920.00	0.15
11	300168	万达信息	55,220.00	0.14
12	002736	国信证券	53,935.00	0.14
13	600900	长江电力	52,780.00	0.14
14	600061	国投安信	50,890.00	0.13
15	002470	金正大	47,860.00	0.13
16	601258	庞大集团	47,375.00	0.12
17	002183	怡亚通	46,682.00	0.12
18	600446	金证股份	45,799.00	0.12
19	601872	招商轮船	44,631.00	0.12
20	002152	广电运通	42,729.00	0.11

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	600016	民生银行	629,474.00	1.65
2	300027	华谊兄弟	453,948.32	1.19
3	601099	太平洋	128,118.00	0.34
4	300024	机器人	126,177.00	0.33
5	600036	招商银行	113,002.00	0.30
6	601318	中国平安	106,994.00	0.28
7	002673	西部证券	99,231.00	0.26
8	600000	浦发银行	98,820.00	0.26
9	600739	辽宁成大	83,425.00	0.22
10	600383	金地集团	80,961.00	0.21
11	000831	*ST 五稀	73,537.00	0.19
12	000686	东北证券	69,068.00	0.18
13	600705	中航资本	58,674.00	0.15

14	300104	乐视网	47,979.00	0.13
15	600315	上海家化	46,614.28	0.12
16	601992	金隅股份	42,747.00	0.11
17	600637	东方明珠	42,517.00	0.11
18	002038	双鹭药业	40,072.00	0.10
19	601238	广汽集团	39,441.00	0.10
20	600549	厦门钨业	38,951.40	0.10

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	3,302,503.71
卖出股票收入（成交）总额	4,192,772.21

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：无。

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：无。

7.7 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：无。

7.8 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：无。

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：无。

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：本基金本报告期内未发生股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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

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

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

本组合投资的前十名证券之一海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）于 2015 年 9 月 10 日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）《行政处罚事先告知书》（处罚字【2015】73 号）（以下简称《告知书》）。根据《告知书》，海通证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条，《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条，《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第（四）项，《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的信息进行审查和了解，违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定，构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第（四）项所述的行为。中国证监会对海通证券责令改正，给予警告，没收违法所得 28,653,000 元，并处以 85,959,000 元罚款。海通证券于 2015 年 11 月 26 日收到证监会的《调查通知书》（稽查总队调查通字 153122 号）。因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对海通证券进行立案调查。

本组合投资的前十名证券之一中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）于 2015 年 11 月 26 日，收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）调查通知书（稽查总队调查通字 153121 号），其中提及：因中信证券涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，中国证监会决定对中信证券进行立案调查。

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	914.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	141.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,056.51

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	736,320.20	2.85	重大事项

7.12.6 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。

7.12.7 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。

§ 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

8.1.1 本基金的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
514	15,938.07	419,925.0	5.13%	7,772,243.0	94.87%

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	张洪琴	698,704.00	8.53%
2	张杰	610,000.00	7.45%
3	金怡	299,525.00	3.66%
4	中外建工程设计与顾问有限公司	231,646.00	2.83%
5	葛惠瑾	218,945.00	2.67%
6	陈洁	207,575.00	2.53%
7	刘宇峰	190,555.00	2.33%
8	余景妍	180,000.00	2.20%
9	刘义	144,566.00	1.76%
10	何学武	110,397.00	1.35%

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

注：截止本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

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、基金投资和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（2013 年 7 月 19 日）基金份额总额	1,306,582,851.00
本报告期期初基金份额总额	10,192,168.00
本报告期基金总申购份额	16,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	18,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	8,192,168.00

§ 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 基金托管人的重大人事变动：

基金托管人本报告期无重大人事变动。

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	
中信证券	1	2,820,486.24	37.63%	2,518.61	37.25%	-
方正证券	2	2,164,576.96	28.88%	1,968.07	29.11%	-
华泰证券	1	1,523,948.12	20.33%	1,388.80	20.54%	-
银河证券	2	971,555.00	12.96%	885.37	13.10%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
海通证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
宏源证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

中航证券	1	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-
中银国际	1	14,709.60	0.20%	-	-
华西证券	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，最近二年未发生因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要，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、选择交易单元的程序：

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元的对象。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。我在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
中信证券	2,000.00	45.35%	-	-	-	-
方正证券	2,410.00	54.65%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

东方财富证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

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
3	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
4	鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月3日
5	2015年年度度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月30日
6	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

		报》	
7	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

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
- (二) 《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
- (三) 《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 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 43 层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区金融大街 25 号中国建设银行股份有限公司

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