

# 鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)2016 年年度报告

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

送出日期：2017 年 3 月 30 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
8.3 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.....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
8.6 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.....	65

8.7 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.....	65
8.8 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贵金属投资明细.....	66
8.9 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.....	66
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
8.12 投资组合报告附注.....	66
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>68</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	68
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
9.4 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.....	69
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>69</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>70</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	70
11.2 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.....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
11.4 基金投资策略的改变.....	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
11.8 其他重大事件.....	72
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>79</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>79</b>
13.1 备查文件目录.....	79
13.2 存放地点.....	80
13.3 查阅方式.....	80

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)
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
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
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
报告期末基金份额总额	209,606,407.20 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	2010 年 4 月 28 日

注：本基金在交易所行情系统净值提示等其他信息披露场合下，可简称为“鹏华 500”。

### 2.2 基金产品说明

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 × 95% + 银行同业存款利率 × 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。

## 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	郭明
	联系电话	0755-82825720	010-66105799
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		何如	易会满

## 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com">http://www.phfund.com</a>
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-9,844,981.59	271,386,146.87	156,462,366.81
本期利润	-45,987,797.64	220,386,668.18	219,941,889.98
加权平均基金份额本期利润	-0.1906	0.6756	0.2997
本期加权平均净值利润率	-15.38%	46.54%	33.91%

本期基金份额净值增长率	-14.12%	35.82%	37.84%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>	<b>2014 年末</b>
期末可供分配利润	59,253,588.47	118,074,481.12	35,848,941.70
期末可供分配基金份额利润	0.2827	0.4940	0.0592
期末基金资产净值	268,859,995.67	357,093,075.66	665,889,761.49
期末基金份额净值	1.283	1.494	1.100
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>	<b>2014 年末</b>
基金份额累计净值增长率	28.30%	49.40%	10.00%

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) 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 12 月 31 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

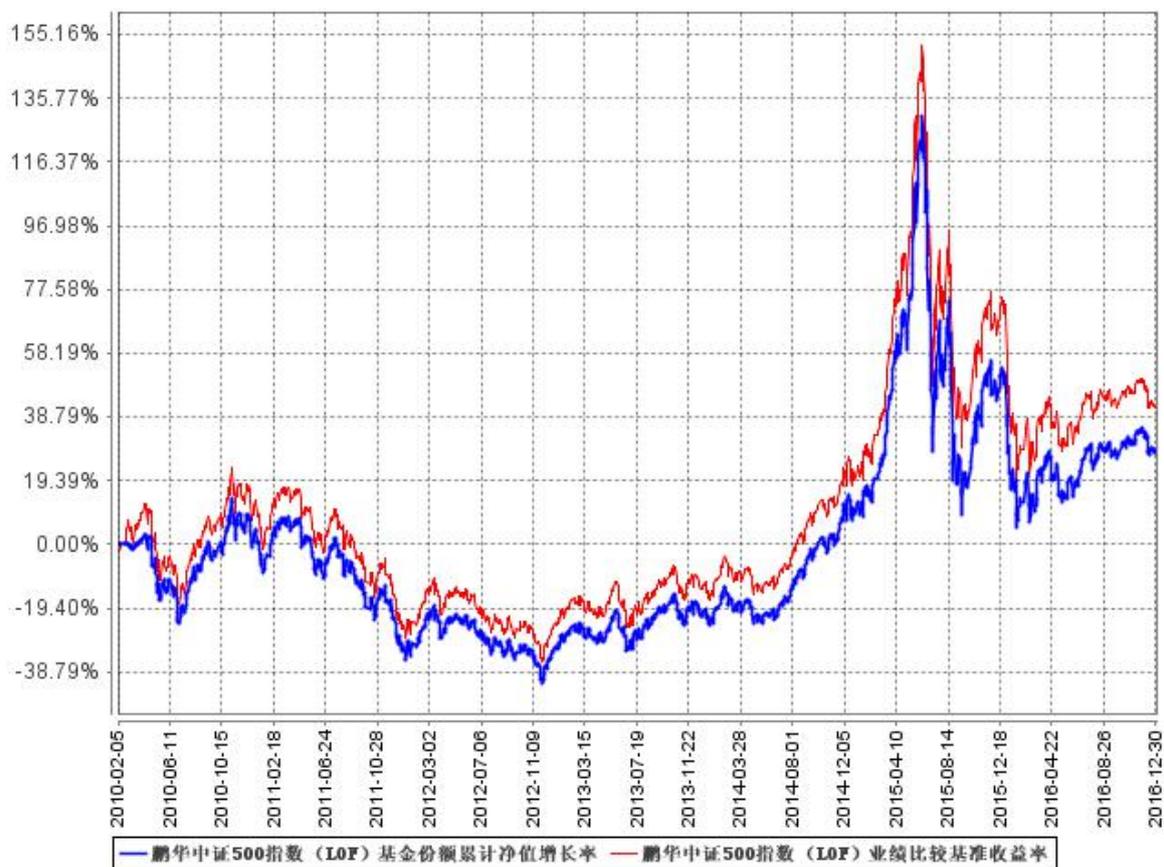
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.39%	0.78%	-0.95%	0.78%	1.34%	0.00%
过去六个月	5.08%	0.88%	2.22%	0.88%	2.86%	0.00%
过去一年	-14.12%	1.85%	-16.76%	1.81%	2.64%	0.04%
过去三年	60.78%	2.11%	61.03%	1.98%	-0.25%	0.13%
过去五年	86.75%	1.86%	87.87%	1.78%	-1.12%	0.08%
自基金合同生效起至今	28.30%	1.78%	41.85%	1.73%	-13.55%	0.05%

注：本基金业绩比较基准为中证 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

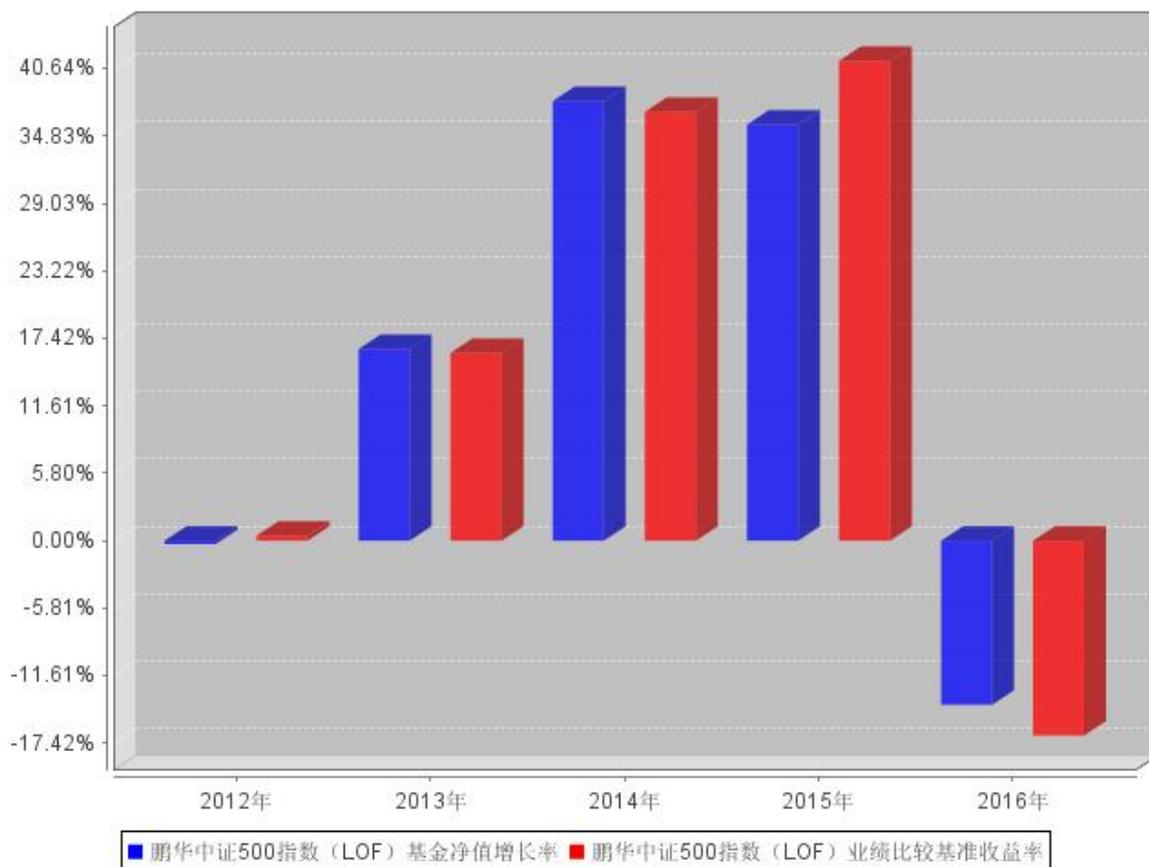


注：1、本基金合同于 2010 年 2 月 5 日生效。

2、截至本基金建仓期结束，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。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华中证500指数 (LOF) 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：截止本报告期末，本基金未进行利润分配。

## § 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。截止本报告期末，公司管理 129 只基金和 10 只全国社保投资组合，经过 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		
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、泰达宏利 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 月至 2016 年 10 月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。
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。

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本基金基金合同的约定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 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, 本基金运作合法合规, 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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》, 将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理, 在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动, 建立对公平交易的执行、监督及审核流程, 严禁在不同投资组合之间进行利益输送。在投资研究环节: 1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”, 确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会; 2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用产品投资管理规定》, 执行股票及信用产品出入库及日常维护工作, 确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据; 3、在公司股票库基础上, 各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库, 基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合; 4、严格执行投资授权制度, 明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分, 合理确定基金经理的投资权限, 超过投资权限的操作, 应严格履行审批程序。在交易执行环节: 1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成, 集中交易室负责建立和执行交易分配制度, 确保各投资组合享有公平的交易执行机会; 2、针对交易所公开竞价交易, 集中交易室应严格启用恒生交易系统中的公平交易程序, 交易系统则自动启用公平交易功能, 由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配; 如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易, 且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时, 交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托; 当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时, 则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式, 进行公平委托和交易量分配; 3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行; 银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易, 各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量, 公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进

行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析；《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

#### 4.3.2 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。同时，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析，未发现存在违反公平交易原则的现象。

#### 4.3.3 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并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 4 次，主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

### 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

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，同时实现了 2.64% 的超额收益。

#### 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 1.283 元；本报告期基金份额净值增长率为 -14.12%，业绩比较

基准收益率-16.76%

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前宏观经济的“筑底回稳”趋势较为明显。在三大需求中，消费需求保持稳中有升，进出口负增长较为反复，PPP项目的加快推进和加速实施，使得投资需求增速小幅回升，总体来看，2016年全年经济波动由“弱”转“稳”，全年GDP同比增长回稳、转暖。2016年A股市场成交活跃度较去年腰斩，风格特征方面大盘股表现较佳，行业表现方面只有食品饮料取得较大绝对正收益。2017预计行情整体呈平衡震荡市，行业轮动加速、个股表现日趋分化，看好“一带一路”，“混改”主题类个股表现。

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，力争为投资者带来超越指数收益的投资回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人继续完善内部控制、提升风险管理水平，着重开展了以下各项工作：

##### 1、继续完善内部控制体系

公司不断更新完善业务流程和运营风险数据库，通过标准化业务流程将业务操作落实到岗，明确业务流程与控制活动的关联关系，确定关键控制活动，以及各个业务操作所使用的相关文档或表单，并将业务操作与法律法规的相关法条建立关联，将控制活动与风险建立关联，将法律法规要求与信息披露报备规则建立关联。

##### 2、继续优化内部控制措施

报告期内，公司继续完善内部控制措施，制定、颁布和更新了一系列公司基本管理制度，通过信息技术手段陆续实现了部分标准化操作流程手册的系统化，并不断优化。

##### 3、持续改进投资监控的方法与手段，保证基金投资业务的合法合规性

报告期内，在投资日常合规监控工作方面，公司根据产品特点进一步完善了投资监控系统以提升投资监控效率；在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上，公司加强了内幕交易风险的检查和防范，明确了内幕交易防范要求，多次开展有关内幕交易的培训，进一步强化全体投研人员对内幕交易行为和结果的认识。

##### 4、规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性

报告期内，在基金募集和持续营销活动中，公司严格规范基金销售业务，按照《证券投资基金销售管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作，本报告期内没有出现主动违规行为。

#### 5、开展以风险为导向的内部稽核

报告期内, 监察稽核部开展了对基金投资管理、市场营销管理、财务费用管理和公司日常运作的定期监察稽核与专项监察稽核。监察稽核人员开展了以风险为导向的内部稽核, 通过稽核发现, 提高了公司标准化操作流程手册的执行效力, 优化了标准化操作流程手册, 更新了风险控制矩阵。报告期内, 公司没有发生重大风险事件。

### 4.7 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。

#### 4.8 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 59,253,588.47 元，期末基金份额净值 1.283 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。

#### 4.9 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

无。

### § 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

本报告期内，本基金托管人在对鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）的管理人——鹏华基金管理有限公司在鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）未进行利润分配。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 21355 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“鹏华中证 500 指数基金”) 的财务报表, 包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益 (基金净值) 变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是鹏华中证 500 指数基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表, 并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。 我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为, 上述鹏华中证 500 指数基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 公允反映了鹏华中证 500 指数基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	单峰	陈熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国 上海市	
审计报告日期	2017 年 3 月 23 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	16,076,936.00	24,436,635.67
结算备付金		19,484.90	278,250.73
存出保证金		35,883.53	117,159.81
交易性金融资产	7.4.7.2	253,384,539.83	333,968,251.07
其中：股票投资		253,384,539.83	333,968,251.07
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		58,822.90	-
应收利息	7.4.7.5	3,205.65	3,936.36
应收股利		-	-
应收申购款		251,820.60	95,732.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		269,830,693.41	358,899,966.26
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,065.72
应付赎回款		120,380.87	516,140.14
应付管理人报酬		173,229.06	232,221.33
应付托管费		34,645.81	46,444.27
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	82,179.39	527,980.21
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	560,262.61	483,038.93
负债合计		970,697.74	1,806,890.60
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	209,606,407.20	239,018,594.54
未分配利润	7.4.7.10	59,253,588.47	118,074,481.12
所有者权益合计		268,859,995.67	357,093,075.66
负债和所有者权益总计		269,830,693.41	358,899,966.26

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.283 元，基金份额总额 209,606,407.20 份。

## 7.2 利润表

会计主体：鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-41,429,659.63	230,198,628.60
1.利息收入		140,883.73	239,303.31
其中：存款利息收入	7.4.7.11	140,655.60	239,303.31
债券利息收入		228.13	-
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）		-5,630,651.39	279,817,293.65
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-7,868,214.39	277,388,702.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	73,971.68	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,163,591.32	2,428,591.23
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-36,142,816.05	-50,999,478.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	202,924.08	1,141,510.33
<b>减：二、费用</b>		4,558,138.01	9,811,960.42
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,241,020.29	3,549,982.42

2. 托管费	7.4.10.2.2	448,204.04	709,996.56
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,279,246.68	4,919,269.44
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	589,667.00	632,712.00
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		-45,987,797.64	220,386,668.18
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		-45,987,797.64	220,386,668.18

### 7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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)	239,018,594.54	118,074,481.12	357,093,075.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-45,987,797.64	-45,987,797.64
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)	-29,412,187.34	-12,833,095.01	-42,245,282.35
其中: 1. 基金申购款	118,124,863.67	23,724,423.08	141,849,286.75
2. 基金赎回款	-147,537,051.01	-36,557,518.09	-184,094,569.10
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)	209,606,407.20	59,253,588.47	268,859,995.67
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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)	605,607,372.08	60,282,389.41	665,889,761.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	220,386,668.18	220,386,668.18
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)	-366,588,777.54	-162,594,576.47	-529,183,354.01
其中：1. 基金申购款	504,473,431.52	267,708,168.63	772,181,600.15
2. 基金赎回款	-871,062,209.06	-430,302,745.10	-1,301,364,954.16
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)	239,018,594.54	118,074,481.12	357,093,075.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)(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[2009]第 1374 号《关于核准鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)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《鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,629,831,732.31 元,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(2009)第 021 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2010 年 2 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,630,723,634.12 份基金份额,其中认购资金利息折合 891,901.81 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2010]第 129 号文审核同意,本基金 583,423,342.00 份基金份额于 2010 年 4 月 28 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管

在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，中证 500 指数的成份股及其备选成份股 (投资比例不低于基金资产净值的 90%)，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，为更好的实现投资目标，本基金将少量投资于非中证 500 成份股、新股 (首次发行或增发等) 以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 X95%+银行同业存款利率 X5%。

#### 7.4.2 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 (以下简称“中国基金业协会”) 颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》和中国证监会、中国基金业协会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币，除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具 (主要为权证投资) 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产

在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1) 金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

(2) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

(3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动作为公允价值变动损益计入当期损益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利以及处置时产生的处置损益计入当期损益。

(4) 金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(4.1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(4.2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(4.3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

(5) 金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

(6) 当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认

为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项, 根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分, 将本金部分冲减资产支持证券投资成本, 并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益; 于处置时, 其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益, 其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算, 实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算, 实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

1、在符合有关基金分红条件的前提下, 本基金每年收益分配次数最多为 6 次, 每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%, 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种: 现金分红与红利再投资, 投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资; 若投资者不选择, 本基金默认的收益分配方式是现金分红; 如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同, 基金注册登记机构将以投资者在各销售机构分别做出的最后一次选择的分红方式为准;

场内认购、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金分红, 投资者不能选择其他的分红方式, 具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值; 即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4、每一基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定。

#### **7.4.4.12 分部报告**

无。

### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 本基金根据中国证券投资基金业协会《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），对于交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期没有发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期没有发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》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。对证券投资基金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,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

2017 年 7 月 1 日(含)以后,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人,按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此,截至 2016 年 12 月 31 日,本基金没有计提有关增值税费用。

(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,股票的股息、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,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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	16,076,936.00	24,436,635.67
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	16,076,936.00	24,436,635.67

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	255,409,439.56	253,384,539.83	-2,024,899.73
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	255,409,439.56	253,384,539.83	-2,024,899.73
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	299,850,334.75	333,968,251.07	34,117,916.32
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	299,850,334.75	333,968,251.07	34,117,916.32

**7.4.7.3 衍生金融资产/负债**

注：无。

**7.4.7.4 买入返售金融资产****7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：无。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：无。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,180.75	3,758.46
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	8.80	125.20
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	16.10	52.70
合计	3,205.65	3,936.36

注：其他为应收结算保证金利息。

**7.4.7.6 其他资产**

注：无。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	82,179.39	527,980.21
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	82,179.39	527,980.21

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	262.61	1,038.93
预提费用	510,000.00	432,000.00
指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	560,262.61	483,038.93

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	239,018,594.54	239,018,594.54
本期申购	118,124,863.67	118,124,863.67
本期赎回(以“-”号填列)	-147,537,051.01	-147,537,051.01
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	209,606,407.20	209,606,407.20

注：申购含红利再投、转换入份额。赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	194,312,766.14	-76,238,285.02	118,074,481.12
本期利润	-9,844,981.59	-36,142,816.05	-45,987,797.64
本期基金份额交易产生的变动数	-21,029,044.19	8,195,949.18	-12,833,095.01
其中：基金申购款	92,460,047.61	-68,735,624.53	23,724,423.08
基金赎回款	-113,489,091.80	76,931,573.71	-36,557,518.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	163,438,740.36	-104,185,151.89	59,253,588.47

#### 7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

	月 31 日	日
活期存款利息收入	133,211.17	213,456.68
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	6,410.80	17,173.01
其他	1,033.63	8,673.62
合计	140,655.60	239,303.31

注：其他为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
卖出股票成交总额	437,440,033.84	1,800,897,782.12
减：卖出股票成本总额	445,308,248.23	1,523,509,079.70
买卖股票差价收入	-7,868,214.39	277,388,702.42

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 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 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31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	73,971.68	-
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	73,971.68	-

##### 7.4.7.13.2 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 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	452,599.81	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	378,400.00	-
减：应收利息总额	228.13	-
买卖债券差价收入	73,971.68	-

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,163,591.32	2,428,591.23
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,163,591.32	2,428,591.23

**7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-36,142,816.05	-50,999,478.69
——股票投资	-36,142,816.05	-50,999,478.69
——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	-36,142,816.05	-50,999,478.69

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	185,338.43	902,377.73
转换费收入	17,585.65	238,787.50
其他	-	345.10
合计	202,924.08	1,141,510.33

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
----	----------------------------------------	---------------------------------------------

	日	31 日
交易所市场交易费用	1, 279, 246. 68	4, 919, 269. 44
银行间市场交易费用	-	-
合计	1, 279, 246. 68	4, 919, 269. 44

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	29, 000. 00	72, 000. 00
信息披露费	300, 000. 00	300, 000. 00
上市年费	60, 000. 00	60, 000. 00
指数使用费	200, 000. 00	200, 000. 00
银行汇划费用	667. 00	700. 00
交易费用	-	12. 00
合计	589, 667. 00	632, 712. 00

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应

税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司 (“鹏华基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司 (“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司 (“国信证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.)	基金管理人的股东
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：1. 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。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
国信证券	370,303,353.50	44.43%	1,316,923,508.76	42.73%

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	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 成交总额的 比例
国信证券	216,353.60	47.80%	-	-

### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国信证券	344,868.60	44.91%	2,963.69	3.61%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国信证券	1,206,602.91	43.31%	271,746.52	51.47%

注：（1）佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=股票买（卖）成交金额×1‰-买（卖）经手费-买（卖）证管费等由券商承担的费用

深圳证券交易所的交易佣金=股票买（卖）成交金额×1‰-买（卖）经手费-买（卖）证管费等由券商承担的费用

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

（2）本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,241,020.29
其中：支付销售机构的客户维护费	557,921.32	834,344.02

注：（1）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0.75%，逐日计提，按月

支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.75%÷当年天数。

(2) 根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

#### 7.4.10.2.2 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12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	448,204.04	709,996.56

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费年费率为0.15%，逐日计提，按月支付。

日托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本年度及上年度可比报告期管理人未投资、持有本基金。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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12月31日		2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	16,076,936.00	133,211.17	24,436,635.67	213,456.68

#### 7.4.10.6 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未参与关联方承销的证券。

### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

### 7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603228	景旺电子	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	23.16	23.16	1,143	26,471.88	26,471.88	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-

603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

注：截止本报告期末，本基金没有持有因新发或增发而流通的债券或权证。

#### 7.4.12.2 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
000887	中鼎股份	2016年11月18日	重大事项	25.94	2017年2月15日	23.99	39,798	788,698.65	1,032,360.12	-
300088	长信科技	2016年9月12日	重大事项	15.80	-	-	63,700	875,101.69	1,006,460.00	-
601168	西部矿业	2016年12月19日	重大事项	7.83	-	-	125,100	912,590.25	979,533.00	-
000748	长城信息	2016年11月1日	重大事项	20.31	-	-	43,600	883,431.02	885,516.00	-
600673	东阳光科	2016年11月15日	重大事项	7.29	-	-	118,649	874,524.37	864,951.21	-
000050	深天马A	2016年9月12日	重大事项	18.82	2017年3月23日	20.70	44,300	857,530.10	833,726.00	-

002400	省广股份	2016 年 11 月 28 日	重大事项	12.79	-	-	61,820	921,463.18	790,677.80	-
002491	通鼎互联	2016 年 12 月 22 日	重大事项	15.54	2017 年 1 月 3 日	15.89	47,300	720,196.00	735,042.00	-
000697	炼石有色	2016 年 11 月 17 日	重大事项	23.51	-	-	30,777	724,249.00	723,567.27	-
600655	豫园商城	2016 年 12 月 20 日	重大事项	11.42	-	-	63,300	829,876.52	722,886.00	-
600161	天坛生物	2016 年 12 月 6 日	重大事项	39.40	2017 年 3 月 24 日	43.34	16,867	537,917.57	664,559.80	-
002602	世纪华通	2016 年 12 月 15 日	重大事项	46.89	2017 年 1 月 9 日	50.00	13,500	303,245.98	633,015.00	-
000563	陕国投 A	2016 年 10 月 14 日	重大事项	7.48	2017 年 1 月 18 日	6.73	83,832	449,908.05	627,063.36	-
600151	航天机电	2016 年 11 月 11 日	重大事项	10.97	-	-	56,743	631,548.50	622,470.71	-
000727	华东科技	2016 年 11 月 17 日	重大事项	3.37	2017 年 2 月 15 日	3.47	175,000	615,638.89	589,750.00	-
000547	航天发展	2016 年 4 月 19 日	重大事项	15.28	2017 年 1 月 3 日	16.90	38,300	560,737.59	585,224.00	-
600645	中源协和	2016 年 12 月 13 日	重大事项	26.80	-	-	20,299	775,539.80	544,013.20	-
002025	航天电器	2016 年 9 月 12 日	重大事项	25.20	-	-	20,267	488,078.86	510,728.40	-
002440	闰土股份	2016 年 10 月 21 日	重大事项	16.34	2017 年 1 月 12 日	15.22	31,074	517,627.34	507,749.16	-

002396	星网锐捷	2016年9月12日	重大事项	19.70	2017年2月21日	18.35	25,537	529,859.04	503,078.90	-
600171	上海贝岭	2016年12月14日	重大事项	14.05	2017年2月16日	14.90	34,862	578,611.84	489,811.10	-
000829	天音控股	2016年9月29日	重大事项	11.28	-	-	39,297	496,107.86	443,270.16	-
600859	王府井	2016年9月27日	重大事项	16.28	-	-	24,749	406,900.44	402,913.72	-
600537	亿晶光电	2016年12月27日	重大事项	7.43	2017年1月13日	8.17	53,028	456,481.92	393,998.04	-
002635	安洁科技	2016年11月8日	重大事项	36.40	2017年2月8日	33.50	10,269	357,279.38	373,791.60	-
601005	重庆钢铁	2016年6月2日	重大事项	2.88	-	-	123,200	446,966.66	354,816.00	-
002727	一心堂	2016年12月28日	重大事项	21.20	2017年1月5日	21.66	16,428	401,942.78	348,273.60	-
002681	奋达科技	2016年12月19日	重大事项	12.93	-	-	23,868	398,981.26	308,613.24	-
000693	ST 华泽	2016年3月1日	重大事项	14.24	-	-	19,205	382,557.31	273,479.20	-
600551	时代出版	2016年11月28日	重大事项	20.32	-	-	13,361	263,987.76	271,495.52	-
603169	兰石重装	2016年11月24日	重大事项	13.36	-	-	20,300	288,040.46	271,208.00	-
603555	贵人鸟	2016年12月12日	重大事项	30.76	-	-	8,100	211,408.52	249,156.00	-

603986	兆易创新	2016年9月19日	重大事项	177.97	2017年3月13日	195.77	982	22,841.32	174,766.54	-
002745	木林森	2016年7月15日	重大事项	36.49	-	-	1,600	61,989.57	58,384.00	-

注：长城信息（000748）于2017年1月17日以0.5424:1[即每1股长城电脑(000066)新发行股份换取0.5424股长城信息（000748）股份]的换股比例转换为长城电脑(000066)发行的A股股份，并于2017年1月18日终止上市。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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、债券型基金、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

在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 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工商银行股份有限公司，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 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2015 年 12 月 31 日：未持有）。

#### 7.4.13.3 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约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。

### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	16,076,936.00	-	-	-	16,076,936.00
结算备付金	19,484.90	-	-	-	19,484.90
存出保证金	35,883.53	-	-	-	35,883.53
交易性金融资产	-	-	-	253,384,539.83	253,384,539.83
应收证券清算款	-	-	-	58,822.90	58,822.90
应收利息	-	-	-	3,205.65	3,205.65
应收申购款	-	-	-	251,820.60	251,820.60
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,132,304.43	-	-	253,698,388.98	269,830,693.41
负债					
应付赎回款	-	-	-	120,380.87	120,380.87
应付管理人报酬	-	-	-	173,229.06	173,229.06
应付托管费	-	-	-	34,645.81	34,645.81
应付交易费用	-	-	-	82,179.39	82,179.39
其他负债	-	-	-	560,262.61	560,262.61
负债总计	-	-	-	970,697.74	970,697.74
利率敏感度缺口	16,132,304.43	-	-	-252,727,691.24	268,859,995.67
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2015 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	24,436,635.67	-	-	-	24,436,635.67
结算备付金	278,250.73	-	-	-	278,250.73
存出保证金	117,159.81	-	-	-	117,159.81
交易性金融资产		-	-	-333,968,251.07	333,968,251.07
应收利息		-	-	-	3,936.36
应收申购款		-	-	-	95,732.62
资产总计	24,832,046.21	-	-	-334,067,920.05	358,899,966.26
负债					
应付证券清算款		-	-	-	1,065.72
应付赎回款		-	-	-	516,140.14
应付管理人报酬		-	-	-	232,221.33
应付托管费		-	-	-	46,444.27
应付交易费用		-	-	-	527,980.21
其他负债		-	-	-	483,038.93
负债总计		-	-	-	1,806,890.60
利率敏感度缺口	24,832,046.21	-	-	-332,261,029.45	357,093,075.66

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 12 月 31 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）。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	253,384,539.83	94.24	333,968,251.07	93.52
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	253,384,539.83	94.24	333,968,251.07	93.52

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	13,701,496.30	16,664,480.35
	业绩比较基准下降 5%	-13,701,496.30	-16,664,480.35

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

## (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 234,184,768.05 元，属于第二层次的余额为 19,199,771.78 元，无属于第三层次的余额 (2015 年 12 月 31 日：第一层次 297,825,853.64 元，第二层次 36,142,397.43 元，无第三层次)。

## (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃 (包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

## (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

## (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 (2015 年 12 月 31 日：同)。

## (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	253,384,539.83	93.91
	其中：股票	253,384,539.83	93.91
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	16,096,420.90	5.97
7	其他各项资产	349,732.68	0.13
8	合计	269,830,693.41	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	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

### 8.2.2 期末积极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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
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

### 8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

## 8.3 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

### 8.3.1 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	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
11	002405	四维图新	54,174	1,048,266.90	0.39
12	000887	中鼎股份	39,798	1,032,360.12	0.38
13	601012	隆基股份	76,324	1,021,978.36	0.38
14	600158	中体产业	42,771	1,008,112.47	0.37
15	300088	长信科技	63,700	1,006,460.00	0.37
16	600525	长园集团	72,097	1,005,753.15	0.37
17	002092	中泰化学	81,768	989,392.80	0.37
18	601168	西部矿业	125,100	979,533.00	0.36
19	000661	长春高新	8,664	969,068.40	0.36
20	300156	神雾环保	38,500	962,885.00	0.36
21	002572	索菲亚	17,600	953,216.00	0.35
22	600166	福田汽车	307,900	951,411.00	0.35
23	600315	上海家化	34,200	927,162.00	0.34

24	002460	赣锋锂业	34,500	914,595.00	0.34
25	600699	均胜电子	27,042	894,819.78	0.33
26	000748	长城信息	43,600	885,516.00	0.33
27	600143	金发科技	113,800	885,364.00	0.33
28	002366	台海核电	16,500	884,730.00	0.33
29	300266	兴源环境	16,100	883,568.00	0.33
30	002422	科伦药业	54,800	883,376.00	0.33
31	300115	长盈精密	33,885	883,043.10	0.33
32	600436	片仔癀	19,200	879,168.00	0.33
33	002340	格林美	133,704	875,761.20	0.33
34	600521	华海药业	39,713	874,877.39	0.33
35	002407	多氟多	31,900	870,551.00	0.32
36	300296	利亚德	25,700	866,604.00	0.32
37	600673	东阳光科	118,649	864,951.21	0.32
38	000581	威孚高科	38,400	861,696.00	0.32
39	002508	老板电器	23,299	857,403.20	0.32
40	000998	隆平高科	40,002	857,242.86	0.32
41	600503	华丽家族	102,000	845,580.00	0.31
42	002168	深圳惠程	53,034	841,119.24	0.31
43	000050	深天马 A	44,300	833,726.00	0.31
44	300026	红日药业	152,900	830,247.00	0.31
45	600664	哈药股份	96,760	830,200.80	0.31
46	600879	航天电子	54,458	829,939.92	0.31
47	000930	中粮生化	61,347	824,503.68	0.31
48	002004	华邦健康	90,435	820,245.45	0.31
49	000997	新大陆	41,686	809,958.98	0.30
50	600614	鹏起科技	69,088	808,329.60	0.30
51	600978	宜华生活	75,454	803,585.10	0.30
52	002439	启明星辰	38,500	800,415.00	0.30
53	600266	北京城建	59,900	798,467.00	0.30
54	600497	驰宏锌锗	113,100	795,093.00	0.30
55	002400	省广股份	61,820	790,677.80	0.29
56	002176	江特电机	66,000	787,380.00	0.29
57	002701	奥瑞金	89,953	777,193.92	0.29
58	600500	中化国际	66,200	771,892.00	0.29
59	000690	宝新能源	83,060	769,966.20	0.29
60	600138	中青旅	36,616	767,837.52	0.29
61	002030	达安基因	32,267	748,594.40	0.28
62	002013	中航机电	40,877	747,640.33	0.28

63	000970	中科三环	55,900	746,265.00	0.28
64	600635	大众公用	123,387	741,555.87	0.28
65	002311	海大集团	48,980	737,149.00	0.27
66	000961	中南建设	70,842	736,756.80	0.27
67	002491	通鼎互联	47,300	735,042.00	0.27
68	600426	华鲁恒升	55,436	734,527.00	0.27
69	002271	东方雨虹	33,772	732,514.68	0.27
70	000697	炼石有色	30,777	723,567.27	0.27
71	600655	豫园商城	63,300	722,886.00	0.27
72	600418	江淮汽车	62,368	720,974.08	0.27
73	002573	清新环境	40,752	711,937.44	0.26
74	300253	卫宁健康	36,150	708,178.50	0.26
75	600122	宏图高科	57,882	707,318.04	0.26
76	600759	洲际油气	71,999	707,030.18	0.26
77	000400	许继电气	38,900	706,035.00	0.26
78	300324	旋极信息	36,400	703,612.00	0.26
79	300113	顺网科技	25,961	698,091.29	0.26
80	002038	双鹭药业	26,100	697,131.00	0.26
81	002179	中航光电	18,980	688,784.20	0.26
82	600565	迪马股份	92,400	685,608.00	0.26
83	600312	平高电气	43,712	682,781.44	0.25
84	600751	天海投资	81,600	682,176.00	0.25
85	600240	华业资本	63,454	681,495.96	0.25
86	002001	新 和 成	34,600	678,160.00	0.25
87	600388	龙净环保	54,400	672,928.00	0.25
88	300244	迪安诊断	21,020	672,640.00	0.25
89	000806	银河生物	42,400	671,616.00	0.25
90	600594	益佰制药	40,200	669,330.00	0.25
91	000959	首钢股份	100,900	667,958.00	0.25
92	002665	首航节能	76,105	666,679.80	0.25
93	600161	天坛生物	16,867	664,559.80	0.25
94	600633	浙报传媒	37,600	664,016.00	0.25
95	002273	水晶光电	33,346	663,585.40	0.25
96	000012	南 玻 A	58,504	663,435.36	0.25
97	000878	云南铜业	55,800	658,998.00	0.25
98	002223	鱼跃医疗	21,237	658,771.74	0.25
99	000975	银泰资源	42,086	658,225.04	0.24
100	000598	兴蓉环境	114,000	656,640.00	0.24
101	600811	东方集团	90,500	647,075.00	0.24

102	000566	海南海药	50,854	646,354.34	0.24
103	600198	大唐电信	40,696	645,845.52	0.24
104	600094	大名城	72,500	645,250.00	0.24
105	600056	中国医药	33,894	645,002.82	0.24
106	300134	大富科技	25,430	644,904.80	0.24
107	002217	合力泰	35,900	642,610.00	0.24
108	000939	凯迪生态	49,922	642,496.14	0.24
109	300159	新研股份	47,300	642,334.00	0.24
110	600601	方正科技	139,201	640,324.60	0.24
111	600528	中铁二局	46,500	639,840.00	0.24
112	600478	科力远	63,948	639,480.00	0.24
113	002221	东华能源	51,418	637,069.02	0.24
114	300273	和佳股份	37,270	635,826.20	0.24
115	000078	海王生物	100,877	635,525.10	0.24
116	600787	中储股份	69,834	633,394.38	0.24
117	600881	亚泰集团	115,768	633,250.96	0.24
118	002602	世纪华通	13,500	633,015.00	0.24
119	000612	焦作万方	54,762	632,501.10	0.24
120	000960	锡业股份	48,200	632,384.00	0.24
121	300055	万邦达	38,600	632,268.00	0.24
122	000563	陕国投 A	83,832	627,063.36	0.23
123	600516	方大炭素	67,700	626,902.00	0.23
124	600549	厦门钨业	28,300	623,166.00	0.23
125	600151	航天机电	56,743	622,470.71	0.23
126	002410	广联达	42,600	621,960.00	0.23
127	600200	江苏吴中	32,094	619,735.14	0.23
128	002048	宁波华翔	27,972	619,300.08	0.23
129	000758	中色股份	77,500	619,225.00	0.23
130	002353	杰瑞股份	30,500	619,150.00	0.23
131	002408	齐翔腾达	56,281	619,091.00	0.23
132	000031	中粮地产	69,283	618,004.36	0.23
133	600435	北方导航	47,372	617,730.88	0.23
134	000988	华工科技	39,350	615,827.50	0.23
135	601699	潞安环能	76,200	613,410.00	0.23
136	000999	华润三九	24,800	613,304.00	0.23
137	002191	劲嘉股份	58,624	610,275.84	0.23
138	600410	华胜天成	56,034	609,089.58	0.23
139	600176	中国巨石	61,824	608,348.16	0.23
140	600851	海欣股份	46,904	606,468.72	0.23

141	000979	中弘股份	228,784	603,989.76	0.22
142	600755	厦门国贸	73,313	601,166.60	0.22
143	002250	联化科技	37,149	601,070.82	0.22
144	000667	美好置业	162,791	600,698.79	0.22
145	600026	中远海能	86,856	591,489.36	0.22
146	000727	华东科技	175,000	589,750.00	0.22
147	002018	华信国际	57,800	587,826.00	0.22
148	000488	晨鸣纸业	56,706	587,474.16	0.22
149	000547	航天发展	38,300	585,224.00	0.22
150	000786	北新建材	56,824	584,718.96	0.22
151	600098	广州发展	52,000	583,440.00	0.22
152	600572	康恩贝	79,677	582,438.87	0.22
153	603766	隆鑫通用	27,787	577,413.86	0.21
154	601929	吉视传媒	137,800	577,382.00	0.21
155	600064	南京高科	34,439	576,853.25	0.21
156	002544	杰赛科技	20,400	574,056.00	0.21
157	600325	华发股份	44,653	571,558.40	0.21
158	000825	太钢不锈	144,900	570,906.00	0.21
159	600575	皖江物流	99,156	570,147.00	0.21
160	600967	北方创业	41,900	568,583.00	0.21
161	600863	内蒙华电	184,600	568,568.00	0.21
162	600160	巨化股份	53,700	568,146.00	0.21
163	000006	深振业 A	60,107	568,011.15	0.21
164	603019	中科曙光	20,400	567,528.00	0.21
165	600108	亚盛集团	99,100	566,852.00	0.21
166	000860	顺鑫农业	25,488	560,736.00	0.21
167	600717	天津港	55,100	555,408.00	0.21
168	002657	中科金财	12,800	552,448.00	0.21
169	600409	三友化工	58,802	552,150.78	0.21
170	600120	浙江东方	19,087	551,996.04	0.21
171	600511	国药股份	18,292	550,589.20	0.20
172	601880	大连港	196,322	549,701.60	0.20
173	600039	四川路桥	115,250	546,285.00	0.20
174	002276	万马股份	36,301	545,604.03	0.20
175	600645	中源协和	20,299	544,013.20	0.20
176	600307	酒钢宏兴	199,100	543,543.00	0.20
177	002281	光迅科技	6,920	543,220.00	0.20
178	600499	科达洁能	71,800	542,808.00	0.20
179	002051	中工国际	23,660	542,287.20	0.20

180	002155	湖南黄金	47,300	541,585.00	0.20
181	300287	飞利信	45,500	541,450.00	0.20
182	002375	亚厦股份	51,100	540,638.00	0.20
183	002078	太阳纸业	80,694	539,035.92	0.20
184	600316	洪都航空	27,400	538,684.00	0.20
185	002672	东江环保	30,537	537,451.20	0.20
186	600416	湘电股份	36,521	537,223.91	0.20
187	600808	马钢股份	189,800	537,134.00	0.20
188	002595	豪迈科技	25,500	536,775.00	0.20
189	600022	山东钢铁	214,200	535,500.00	0.20
190	002390	信邦制药	54,087	534,920.43	0.20
191	002019	亿帆医药	34,900	533,621.00	0.20
192	000513	丽珠集团	8,948	532,406.00	0.20
193	002444	巨星科技	34,095	531,882.00	0.20
194	002640	跨境通	29,000	530,700.00	0.20
195	000028	国药一致	7,857	525,633.30	0.20
196	300199	翰宇药业	29,200	525,016.00	0.20
197	002489	浙江永强	69,229	524,063.53	0.19
198	000685	中山公用	46,974	522,820.62	0.19
199	002384	东山精密	26,656	522,724.16	0.19
200	600611	大众交通	79,387	521,572.59	0.19
201	000066	长城电脑	41,912	521,385.28	0.19
202	600600	青岛啤酒	17,700	521,088.00	0.19
203	002022	科华生物	26,054	521,080.00	0.19
204	000543	皖能电力	68,351	520,151.11	0.19
205	000089	深圳机场	65,000	520,000.00	0.19
206	002268	卫士通	16,500	518,430.00	0.19
207	600587	新华医疗	20,573	516,588.03	0.19
208	600348	阳泉煤业	76,500	514,845.00	0.19
209	601000	唐山港	128,360	514,723.60	0.19
210	002266	浙富控股	89,140	513,446.40	0.19
211	600770	综艺股份	49,475	512,066.25	0.19
212	600597	光明乳业	39,200	511,952.00	0.19
213	600062	华润双鹤	23,000	511,290.00	0.19
214	002025	航天电器	20,267	510,728.40	0.19
215	000401	冀东水泥	42,800	509,320.00	0.19
216	002440	闰土股份	31,074	507,749.16	0.19
217	002050	三花智控	45,862	506,316.48	0.19
218	600366	宁波韵升	25,680	505,639.20	0.19

219	000519	中兵红箭	33,908	505,229.20	0.19
220	002396	星网锐捷	25,537	503,078.90	0.19
221	002261	拓维信息	42,200	503,024.00	0.19
222	600884	杉杉股份	35,646	501,895.68	0.19
223	300122	智飞生物	30,400	500,688.00	0.19
224	002477	雏鹰农牧	99,712	500,554.24	0.19
225	600380	健康元	50,361	500,084.73	0.19
226	600872	中炬高新	35,478	499,530.24	0.19
227	600187	国中水务	92,600	499,114.00	0.19
228	000592	平潭发展	73,800	498,888.00	0.19
229	600183	生益科技	45,352	498,872.00	0.19
230	600300	维维股份	74,422	497,138.96	0.18
231	600392	盛和资源	37,122	494,836.26	0.18
232	002603	以岭药业	28,700	494,788.00	0.18
233	600171	上海贝岭	34,862	489,811.10	0.18
234	600267	海正药业	36,800	483,920.00	0.18
235	002373	千方科技	35,014	483,193.20	0.18
236	002431	棕榈股份	52,480	480,716.80	0.18
237	002122	天马股份	37,837	480,151.53	0.18
238	600073	上海梅林	41,776	478,335.20	0.18
239	300274	阳光电源	45,240	476,829.60	0.18
240	600067	冠城大通	66,486	476,039.76	0.18
241	002308	威创股份	32,259	475,497.66	0.18
242	600970	中材国际	66,950	474,675.50	0.18
243	002073	软控股份	41,814	474,588.90	0.18
244	600422	昆药集团	35,114	474,390.14	0.18
245	600017	日照港	117,107	474,283.35	0.18
246	600125	铁龙物流	57,963	468,341.04	0.17
247	600086	东方金钰	43,022	468,079.36	0.17
248	600298	安琪酵母	26,218	467,204.76	0.17
249	600284	浦东建设	35,306	465,686.14	0.17
250	600216	浙江医药	36,700	465,356.00	0.17
251	600175	美都能源	94,000	465,300.00	0.17
252	000703	恒逸石化	30,906	464,517.18	0.17
253	600557	康缘药业	27,390	463,712.70	0.17
254	000810	创维数字	32,900	462,903.00	0.17
255	000926	福星股份	36,325	462,780.50	0.17
256	002437	誉衡药业	55,855	461,920.85	0.17
257	600651	飞乐音响	43,791	461,119.23	0.17

258	002358	森源电气	24,012	460,550.16	0.17
259	300010	立思辰	27,700	460,374.00	0.17
260	300291	华录百纳	20,617	459,346.76	0.17
261	600260	凯乐科技	29,659	459,121.32	0.17
262	000816	智慧农业	72,161	458,943.96	0.17
263	601311	骆驼股份	28,054	458,121.82	0.17
264	000937	冀中能源	67,500	454,950.00	0.17
265	000418	小天鹅 A	14,059	454,386.88	0.17
266	600536	中国软件	18,875	454,132.50	0.17
267	002512	达华智能	27,800	453,974.00	0.17
268	000762	西藏矿业	26,590	452,827.70	0.17
269	002002	鸿达兴业	61,438	450,954.92	0.17
270	002479	富春环保	30,406	450,616.92	0.17
271	002028	思源电气	33,924	447,118.32	0.17
272	300001	特锐德	25,700	445,638.00	0.17
273	000829	天音控股	39,297	443,270.16	0.16
274	600694	大商股份	11,100	443,223.00	0.16
275	601801	皖新传媒	25,172	442,272.04	0.16
276	601231	环旭电子	41,200	441,252.00	0.16
277	000021	深科技	46,656	439,966.08	0.16
278	000777	中核科技	19,545	437,417.10	0.16
279	600169	太原重工	107,900	434,837.00	0.16
280	300166	东方国信	20,800	432,432.00	0.16
281	002399	海普瑞	23,700	431,814.00	0.16
282	601717	郑煤机	61,305	430,974.15	0.16
283	002325	洪涛股份	53,550	428,935.50	0.16
284	300202	聚龙股份	17,422	428,581.20	0.16
285	601010	文峰股份	81,423	428,284.98	0.16
286	600765	中航重机	29,695	425,529.35	0.16
287	001696	宗申动力	45,245	425,303.00	0.16
288	600880	博瑞传播	48,500	424,860.00	0.16
289	600517	置信电气	43,632	424,539.36	0.16
290	002041	登海种业	22,390	422,723.20	0.16
291	600259	广晟有色	9,931	421,968.19	0.16
292	002503	搜于特	29,160	419,612.40	0.16
293	600545	新疆城建	34,442	418,814.72	0.16
294	000848	承德露露	37,386	418,349.34	0.16
295	600809	山西汾酒	16,600	415,332.00	0.15
296	002707	众信旅游	26,700	415,185.00	0.15

297	002244	滨江集团	59,392	414,556.16	0.15
298	002123	梦网荣信	27,600	414,000.00	0.15
299	600736	苏州高新	45,613	411,885.39	0.15
300	600058	五矿发展	27,000	411,210.00	0.15
301	000620	新华联	48,233	409,015.84	0.15
302	000572	海马汽车	75,901	406,829.36	0.15
303	002589	瑞康医药	12,500	405,625.00	0.15
304	002581	未名医药	16,700	405,309.00	0.15
305	002368	太极股份	13,241	405,307.01	0.15
306	000600	建投能源	45,600	404,928.00	0.15
307	002063	远光软件	30,805	404,777.70	0.15
308	000587	金洲慈航	27,082	402,980.16	0.15
309	600859	王府井	24,749	402,913.72	0.15
310	600639	浦东金桥	21,611	401,100.16	0.15
311	600835	上海机电	20,546	401,057.92	0.15
312	000158	常山股份	32,000	400,000.00	0.15
313	002344	海宁皮城	35,300	399,596.00	0.15
314	002106	莱宝高科	35,500	399,020.00	0.15
315	002269	美邦服饰	79,500	398,295.00	0.15
316	601777	力帆股份	41,428	396,051.68	0.15
317	002285	世联行	52,100	395,960.00	0.15
318	600537	亿晶光电	53,028	393,998.04	0.15
319	603188	亚邦股份	22,000	392,920.00	0.15
320	603077	和邦生物	76,500	391,680.00	0.15
321	600282	南钢股份	126,100	390,910.00	0.15
322	600433	冠豪高新	48,600	389,772.00	0.14
323	600220	江苏阳光	89,758	389,549.72	0.14
324	600291	西水股份	20,300	389,354.00	0.14
325	000062	深圳华强	13,700	389,217.00	0.14
326	600481	双良节能	51,576	387,851.52	0.14
327	002354	天神娱乐	5,600	387,296.00	0.14
328	000636	风华高科	39,500	385,520.00	0.14
329	601678	滨化股份	52,792	384,853.68	0.14
330	002317	众生药业	31,102	384,109.70	0.14
331	002277	友阿股份	26,741	384,000.76	0.14
332	600993	马应龙	19,224	383,903.28	0.14
333	600053	九鼎投资	8,300	382,298.00	0.14
334	002428	云南锗业	30,078	381,088.26	0.14
335	600805	悦达投资	44,875	380,988.75	0.14

336	600270	外运发展	23,022	380,783.88	0.14
337	000616	海航投资	72,840	380,224.80	0.14
338	300147	香雪制药	29,446	379,853.40	0.14
339	600289	亿阳信通	29,207	378,230.65	0.14
340	600580	卧龙电气	41,486	377,522.60	0.14
341	601689	拓普集团	12,800	376,576.00	0.14
342	600277	亿利洁能	52,900	376,119.00	0.14
343	002161	远望谷	32,620	376,108.60	0.14
344	300257	开山股份	21,900	375,804.00	0.14
345	600894	广日股份	27,362	374,038.54	0.14
346	002635	安洁科技	10,269	373,791.60	0.14
347	300297	蓝盾股份	29,900	371,956.00	0.14
348	000669	金鸿能源	21,666	371,571.90	0.14
349	002505	大康农业	104,670	370,531.80	0.14
350	000973	佛塑科技	49,206	369,045.00	0.14
351	000090	天健集团	38,104	368,084.64	0.14
352	002498	汉缆股份	85,600	368,080.00	0.14
353	000528	柳工	50,100	366,231.00	0.14
354	002482	广田集团	39,537	365,717.25	0.14
355	000501	鄂武商 A	18,704	365,102.08	0.14
356	000541	佛山照明	37,006	364,139.04	0.14
357	600826	兰生股份	13,328	364,120.96	0.14
358	000830	鲁西化工	65,127	364,059.93	0.14
359	000726	鲁泰 A	28,362	363,317.22	0.14
360	600006	东风汽车	52,743	362,871.84	0.13
361	002690	美亚光电	17,100	361,836.00	0.13
362	000652	泰达股份	65,504	361,582.08	0.13
363	600458	时代新材	25,490	360,683.50	0.13
364	600112	天成控股	32,821	360,374.58	0.13
365	002056	横店东磁	25,904	360,324.64	0.13
366	600729	重庆百货	15,371	360,142.53	0.13
367	600823	世茂股份	51,127	358,911.54	0.13
368	002128	露天煤业	41,600	357,760.00	0.13
369	000969	安泰科技	33,674	354,923.96	0.13
370	601005	重庆钢铁	123,200	354,816.00	0.13
371	002005	德豪润达	61,630	354,372.50	0.13
372	600750	江中药业	11,482	353,875.24	0.13
373	600596	新安股份	34,550	353,792.00	0.13
374	002463	沪电股份	73,819	352,854.82	0.13

375	000897	津滨发展	82,322	352,338.16	0.13
376	002242	九阳股份	19,541	352,324.23	0.13
377	002190	成飞集成	11,000	351,780.00	0.13
378	002064	华峰氨纶	63,922	350,931.78	0.13
379	000680	山推股份	63,177	349,368.81	0.13
380	002727	一心堂	16,428	348,273.60	0.13
381	600351	亚宝药业	35,023	346,027.24	0.13
382	600141	兴发集团	22,748	345,997.08	0.13
383	600628	新世界	24,469	345,746.97	0.13
384	000861	海印股份	70,767	343,219.95	0.13
385	600395	盘江股份	42,200	340,554.00	0.13
386	000681	视觉中国	17,800	339,268.00	0.13
387	601233	桐昆股份	23,469	337,014.84	0.13
388	000596	古井贡酒	7,400	336,700.00	0.13
389	002588	史丹利	29,620	336,187.00	0.13
390	002254	泰和新材	27,144	335,499.84	0.12
391	600428	中远海特	54,522	333,674.64	0.12
392	002011	盾安环境	35,005	333,247.60	0.12
393	600790	轻纺城	46,160	332,352.00	0.12
394	600869	智慧能源	42,854	331,689.96	0.12
395	300032	金龙机电	20,600	331,454.00	0.12
396	600773	西藏城投	27,765	331,236.45	0.12
397	000552	靖远煤电	87,318	330,935.22	0.12
398	002663	普邦股份	54,478	330,681.46	0.12
399	600496	精工钢构	76,923	329,230.44	0.12
400	000049	德赛电池	7,808	328,326.40	0.12
401	603198	迎驾贡酒	15,200	327,560.00	0.12
402	601001	大同煤业	53,300	325,663.00	0.12
403	002642	荣之联	16,200	325,620.00	0.12
404	002345	潮宏基	26,934	325,362.72	0.12
405	600862	中航高科	26,500	324,360.00	0.12
406	300039	上海凯宝	31,638	323,656.74	0.12
407	600720	祁连山	39,554	323,156.18	0.12
408	600850	华东电脑	13,347	322,730.46	0.12
409	002699	美盛文化	9,500	321,100.00	0.12
410	600757	长江传媒	38,444	319,469.64	0.12
411	300043	星辉娱乐	31,500	319,410.00	0.12
412	002093	国脉科技	28,750	318,262.50	0.12
413	600059	古越龙山	30,888	316,293.12	0.12

414	000099	中信海直	26,922	315,256.62	0.12
415	603369	今世缘	23,900	313,568.00	0.12
416	600329	中新药业	17,962	313,257.28	0.12
417	000869	张裕A	8,700	313,200.00	0.12
418	601886	江河集团	29,400	313,110.00	0.12
419	603883	老百姓	6,700	312,555.00	0.12
420	600563	法拉电子	8,523	312,538.41	0.12
421	600280	中央商场	36,132	311,096.52	0.12
422	002681	奋达科技	23,868	308,613.24	0.11
423	002371	七星电子	11,575	307,895.00	0.11
424	600292	远达环保	24,843	307,307.91	0.11
425	600831	广电网络	23,047	300,993.82	0.11
426	600586	金晶科技	64,968	300,801.84	0.11
427	002332	仙琚制药	23,285	299,677.95	0.11
428	000426	兴业矿业	34,240	298,572.80	0.11
429	000417	合肥百货	34,349	296,431.87	0.11
430	600657	信达地产	48,534	296,057.40	0.11
431	002342	巨力索具	42,788	295,665.08	0.11
432	600460	士兰微	47,169	293,391.18	0.11
433	002309	中利集团	20,631	293,166.51	0.11
434	600195	中牧股份	13,734	291,847.50	0.11
435	002029	七匹狼	28,560	291,597.60	0.11
436	000931	中关村	34,388	291,266.36	0.11
437	600748	上实发展	35,212	288,386.28	0.11
438	601002	晋亿实业	30,269	288,160.88	0.11
439	600825	新华传媒	33,121	287,821.49	0.11
440	002416	爱施德	19,500	287,235.00	0.11
441	600640	号百控股	14,087	281,458.26	0.10
442	002551	尚荣医疗	14,130	281,328.30	0.10
443	000877	天山股份	39,248	276,698.40	0.10
444	600466	蓝光发展	28,600	276,562.00	0.10
445	601908	京运通	38,522	274,276.64	0.10
446	000693	ST华泽	19,205	273,479.20	0.10
447	600776	东方通信	31,805	272,250.80	0.10
448	600551	时代出版	13,361	271,495.52	0.10
449	603169	兰石重装	20,300	271,208.00	0.10
450	002414	高德红外	11,850	269,943.00	0.10
451	002698	博实股份	17,276	268,987.32	0.10
452	002251	步步高	16,299	268,118.55	0.10

453	600743	华远地产	59,727	265,785.15	0.10
454	600180	瑞茂通	19,438	263,190.52	0.10
455	000919	金陵药业	19,210	259,911.30	0.10
456	603555	贵人鸟	8,100	249,156.00	0.09
457	600335	国机汽车	20,308	246,742.20	0.09
458	600338	西藏珠峰	8,500	246,330.00	0.09
459	600425	青松建化	52,710	245,101.50	0.09
460	600251	冠农股份	30,030	243,543.30	0.09
461	603806	福斯特	5,200	240,604.00	0.09
462	600801	华新水泥	31,007	240,304.25	0.09
463	002327	富安娜	26,888	236,614.40	0.09
464	603355	莱克电气	5,100	235,467.00	0.09
465	002118	紫鑫药业	32,496	233,971.20	0.09
466	601016	节能风电	26,400	233,640.00	0.09
467	603001	奥康国际	10,123	231,816.70	0.09
468	600864	哈投股份	20,155	230,170.10	0.09
469	600397	安源煤业	44,137	227,746.92	0.08
470	000631	顺发恒业	46,417	227,443.30	0.08
471	600874	创业环保	27,739	225,518.07	0.08
472	002646	青青稞酒	11,536	222,068.00	0.08
473	002315	焦点科技	3,666	221,023.14	0.08
474	002392	北京利尔	38,160	219,801.60	0.08
475	600483	福能股份	19,800	219,186.00	0.08
476	603698	航天工程	7,900	217,961.00	0.08
477	002233	塔牌集团	22,852	213,666.20	0.08
478	000517	荣安地产	40,600	213,556.00	0.08
479	603567	珍宝岛	10,800	213,408.00	0.08
480	603005	晶方科技	7,072	212,442.88	0.08
481	600184	光电股份	9,740	210,189.20	0.08
482	600618	氯碱化工	14,298	208,607.82	0.08
483	603328	依顿电子	6,304	201,601.92	0.07
484	603568	伟明环保	8,650	201,545.00	0.07
485	600971	恒源煤电	31,822	199,523.94	0.07
486	000723	美锦能源	13,000	196,560.00	0.07
487	002194	武汉凡谷	15,234	195,909.24	0.07
488	002249	大洋电机	22,650	195,469.50	0.07
489	000025	特力A	3,500	193,445.00	0.07
490	600088	中视传媒	8,412	184,391.04	0.07
491	600468	百利电气	13,917	181,199.34	0.07

492	002238	天威视讯	11,797	172,826.05	0.06
493	600917	重庆燃气	10,900	143,771.00	0.05
494	603377	东方时尚	3,300	133,221.00	0.05
495	600981	汇鸿集团	15,600	132,444.00	0.05
496	603025	大豪科技	3,200	124,896.00	0.05
497	603866	桃李面包	2,800	122,920.00	0.05
498	000761	本钢板材	19,100	102,758.00	0.04
499	002745	木林森	1,600	58,384.00	0.02
500	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.01

### 8.3.2 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

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	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
6	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.05
7	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.04
8	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.03
9	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.03
10	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.03
11	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.02
12	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.02
13	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.02
14	603886	元祖股份	1,681	29,753.70	0.01
15	603228	景旺电子	1,143	26,471.88	0.01
16	603239	浙江仙通	815	25,631.75	0.01
17	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.01
18	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.01
19	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.01
20	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.01
21	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
22	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
23	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
24	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00

25	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
26	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	601012	隆基股份	4,426,253.60	1.24
2	600200	江苏吴中	3,325,148.00	0.93
3	601000	唐山港	3,149,258.00	0.88
4	000656	金科股份	2,893,239.00	0.81
5	600859	王府井	2,884,638.54	0.81
6	600823	世茂股份	2,875,293.78	0.81
7	002309	中利集团	2,718,784.01	0.76
8	600736	苏州高新	2,698,517.00	0.76
9	600026	中远海能	2,674,682.49	0.75
10	600879	航天电子	2,608,515.00	0.73
11	600498	烽火通信	2,268,166.50	0.64
12	000852	石化机械	2,239,941.00	0.63
13	600329	中新药业	2,237,035.92	0.63
14	600522	中天科技	2,146,480.78	0.60
15	600219	南山铝业	2,137,952.04	0.60
16	002477	雏鹰农牧	2,104,304.34	0.59
17	600270	外运发展	2,020,151.24	0.57
18	600657	信达地产	1,912,157.70	0.54
19	000028	国药一致	1,897,964.53	0.53
20	000926	福星股份	1,871,464.43	0.52

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。

### 8.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601012	隆基股份	5,456,280.42	1.53

2	600200	江苏吴中	4,508,810.00	1.26
3	600880	博瑞传播	4,146,914.00	1.16
4	600816	安信信托	3,954,094.56	1.11
5	600498	烽火通信	3,913,588.77	1.10
6	601000	唐山港	3,732,728.00	1.05
7	600823	世茂股份	3,416,512.60	0.96
8	600879	航天电子	3,319,594.86	0.93
9	002309	中利集团	2,992,592.13	0.84
10	600859	王府井	2,977,804.69	0.83
11	300072	三聚环保	2,967,960.38	0.83
12	600522	中天科技	2,931,651.50	0.82
13	600736	苏州高新	2,884,319.97	0.81
14	002466	天齐锂业	2,881,474.20	0.81
15	000656	金科股份	2,831,648.00	0.79
16	000550	江铃汽车	2,542,700.09	0.71
17	600329	中新药业	2,517,731.00	0.71
18	002221	东华能源	2,509,661.34	0.70
19	000501	鄂武商 A	2,452,589.35	0.69
20	600026	中远海能	2,403,771.95	0.67

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。

#### 8.4.3 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	400,859,088.04
卖出股票收入（成交）总额	437,440,033.84

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

## 8.8 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贵金属投资明细

注：无。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

#### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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	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

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 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。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五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	603986	兆易创新	174,766.54	0.07	重大事项

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
13,592	15,421.31	348,558.6	0.17%	209,257,848.6	99.83%

## 9.2 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	冷利群	694,024.00	7.80%
2	高炜	290,000.00	3.26%
3	黄月明	277,000.00	3.11%
4	深圳市博凯保健品有限公司	200,028.00	2.25%
5	张宏旭	200,012.00	2.25%
6	施红梅	197,014.00	2.21%
7	卢翠馨	195,030.00	2.19%
8	陈吉荃	150,042.00	1.69%
9	罗丽珊	149,325.00	1.68%
10	鹿敏理	119,003.00	1.34%

注：持有人为场内持有人。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	40,251.35	0.0192%

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

## 9.4 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：截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2010 年 2 月 5 日) 基金份额总额	2,630,723,634.12
本报告期期初基金份额总额	239,018,594.54
本报告期基金总申购份额	118,124,863.67
减:本报告期基金总赎回份额	147,537,051.01
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-

本报告期末基金份额总额	209,606,407.20
-------------	----------------

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

报告期内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。

经公司董事会审议通过，公司同意聘任韩亚庆先生担任公司副总经理。韩亚庆先生任职日期自 2017 年 3 月 22 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

报告期内基金托管人的重大人事变动：

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

## 11.5 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。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 7 年。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
国信证券	2	370,303,353.50	44.43%	344,868.60	44.91%	-
长江证券	1	268,708,235.44	32.24%	244,874.26	31.89%	-
中航证券	1	128,869,099.65	15.46%	117,438.73	15.29%	-
银河证券	1	50,094,336.62	6.01%	46,654.02	6.08%	-
广发证券	1	15,399,792.18	1.85%	14,033.97	1.83%	-

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。我公司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。

## 11.7.2 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
国信证券	216,353.60	47.80%	-	-	-	-
长江证券	105,506.21	23.31%	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	130,740.00	28.89%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 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基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月5日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月6日
4	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
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月8日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月9日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月12日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月14日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时	2016年1月16日

	变更的提示性公告	报》	
10	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
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 21 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 22 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 26 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 27 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 28 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 29 日
17	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与平安证券申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 1 月 29 日
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 2 月 17 日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 2 月 23 日
20	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔申购最低金额及赎回持有最低份额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 2 月 24 日
21	关于旗下基金所持金亚科技 (300028) 估值调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 2 月 24 日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 2 月 26 日
23	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 2 月 27 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《上	2016 年 3 月 1 日

	基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	海证券报》、《证券时报》	
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 3 日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与光大证券网上交易和手机客户端申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 10 日
27	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 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 17 日
28	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 19 日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 22 日
30	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 24 日
31	关于旗下基金所持沃森生物 (300142) 估值调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 29 日
32	2015 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 30 日
33	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 3 月 30 日
34	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 6 日
35	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 7 日
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 12 日
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 14 日
38	鹏华基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《上	2016 年 4 月 14 日

	基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	海证券报》、《证券时报》	
39	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海陆金所资产管理有限公司基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 18 日
40	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
41	鹏华基金管理有限公司关于增加江苏江南农村商业银行股份有限公司为旗下部分开放式基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 20 日
42	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 21 日
43	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 4 月 22 日
44	鹏华基金管理有限公司关于增加第一创业证券股份有限公司为我司旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 3 日
45	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 5 日
46	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 10 日
47	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 11 日
48	鹏华基金关于旗下部分开放式基金参加中国民生银行直销银行“基金通”申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 17 日
49	鹏华基金管理有限公司关于增加中国民族证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 30 日
50	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中国民生银行股份有限公司开通定投业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 5 月 31 日
51	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时	2016 年 6 月 1 日

	变更的提示性公告	报》	
52	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 6 月 8 日
53	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 6 月 14 日
54	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
55	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 6 月 28 日
56	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购手续费费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 6 月 30 日
57	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在上海陆金所资产管理有限公司开通基金定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 7 月 1 日
58	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与第一创业申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 7 月 1 日
59	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 7 月 2 日
60	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 7 月 5 日
61	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 7 月 7 日
62	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 7 月 8 日
63	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 7 月 12 日
64	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 7 月 13 日
65	鹏华基金管理有限公司关于增加华融证券股份有限公司为旗下部	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时	2016 年 7 月 15 日

	分基金销售机构的公告	报》	
66	2016 年第二季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 7 月 21 日
67	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 7 月 28 日
68	鹏华基金管理有限公司关于在网上直销与直销柜台渠道开展旗下指定货币基金与指数基金及指数基金之间转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 7 月 29 日
69	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 8 月 16 日
70	2016 年半年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 8 月 29 日
71	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 9 月 9 日
72	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 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 9 月 19 日
73	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 9 月 20 日
74	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 9 月 24 日
75	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与广发银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 9 月 28 日
76	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 10 月 19 日
77	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 10 月 22 日
78	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 10 月 25 日
79	2016 年第三季度报告	《中国证券报》、《上	2016 年 10 月 25 日

		海证券报》、《证券时报》	
80	鹏华基金管理有限公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 11 月 2 日
81	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 11 月 11 日
82	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 11 月 14 日
83	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 11 月 15 日
84	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与北京新浪仓石基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 11 月 24 日
85	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行渠道基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 11 月 29 日
86	鹏华基金关于旗下部分开放式基金参与中国民生银行直销银行“基金通”定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 11 月 30 日
87	鹏华基金管理有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 12 月 3 日
88	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与北京汇成基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 12 月 3 日
89	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 12 月 3 日
90	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 12 月 8 日
91	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与北京蛋卷基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 12 月 9 日
92	鹏华基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《上	2016 年 12 月 13 日

	基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	海证券报》、《证券时报》	
93	鹏华基金管理有限公司关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 12 月 19 日
94	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 12 月 20 日
95	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行渠道基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 12 月 22 日
96	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 12 月 24 日
97	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国邮政储蓄银行网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 12 月 28 日
98	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东莞银行网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 12 月 30 日
99	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国农业银行网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016 年 12 月 30 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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 年年度报告》(原文)。

### 13.2 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。

### 13.3 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 3 月 30 日