

鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF） 2017 年半年度报告

2017 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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 2017 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	56
7.7 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.....	56
7.8 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.....	56
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.....	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
§8 基金份额持有人信息.....	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
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.....	60
§9 开放式基金份额变动.....	61
§10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	63

§11 影响投资者决策的其他重要信息	67
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录.....	68
12.2 存放地点.....	68
12.3 查阅方式.....	68

§ 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	238,953,463.03 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

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，以实现中证 500 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法，原则上按照成份股在中证 500 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率 \times 95% + 银行同业存款利率 \times 5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益品种。

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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
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
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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	7,099,976.03
本期利润	4,396,454.05
加权平均基金份额本期利润	0.0207
本期加权平均净值利润率	1.60%
本期基金份额净值增长率	1.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	70,734,754.94
期末可供分配基金份额利润	0.2960
期末基金资产净值	309,688,217.97
期末基金份额净值	1.296
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	29.60%

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

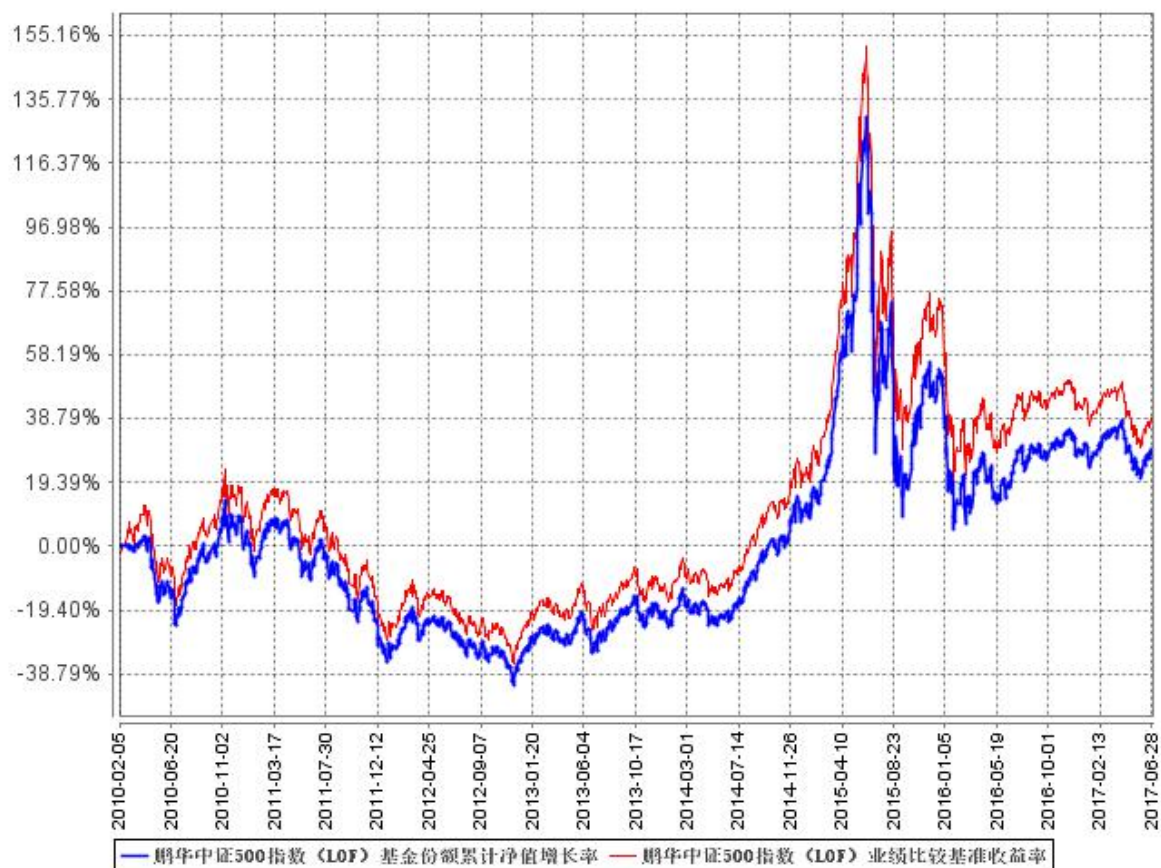
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.37%	0.89%	5.12%	0.89%	0.25%	0.00%
过去三个月	-2.85%	0.98%	-3.89%	0.97%	1.04%	0.01%
过去六个月	1.01%	0.85%	-1.86%	0.85%	2.87%	0.00%
过去一年	6.14%	0.87%	0.31%	0.86%	5.83%	0.01%
过去三年	61.19%	2.09%	54.26%	1.96%	6.93%	0.13%
自基金合同生效起至今	29.60%	1.74%	39.21%	1.68%	-9.61%	0.06%

注：本基金业绩比较基准=中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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、鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同于 2010 年 2 月 5 日生效。

2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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 2017 年 6 月, 公司管理资产总规模达到 4509.30 亿元, 管理 149 只公募基金、10 只全国社保投资组合、2 只基本养老保险投资组合。经过近 19 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		
张羽翔	本基金基金经理	2016 年 9 月 24 日	-	10	张羽翔先生, 国籍中国, 工学硕士, 10 年金融证券从业经验。曾任招商银行软件中心 (原深圳市融博技术公司) 数据分析师; 2011 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任监察稽核部资深金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员, 先后从事金融工程、量化研究等工作; 2015 年 9 月起担任鹏华上证民企 50ETF 基金及其联接基金基金经理, 2016 年 6 月起兼任鹏华新丝路分级基金基金经理, 2016 年 7 月起兼任鹏华高铁产业分级基金基金经理, 2016 年 9 月起兼任鹏华中证 500 指数 (LOF)、鹏华沪深 300 指数 (LOF) 基金基金经理, 2016 年 11 月起兼任鹏华一带一路分级、鹏华新能源分级基金基金经理。张羽翔先生具备基金从业资格。张羽翔先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 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

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, 跟踪指数收益, 力争将基金跟踪误差控制在合理范围内。

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 1.296, 本报告期基金份额净值增长率为 1.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年上半年, 上市公司整体盈利持续向好, 主板优势明显, 上中游业绩持续提升, 周期、消费强势不改, 其中煤炭、航运、水泥等二级行业业绩大幅提升。当前周期类板块受全球贸易和美国经济的回暖, 有望继续延续当前的经济增长活力。社会消费支出对于经济增长贡献明显, 位列“三驾马车”之首, 在资本市场上, 业绩稳定的大消费股受到资金的追捧, 尤其是上半年的家电、白酒板块, 业绩争先爆发。

中国经济现正处于在本轮库存周期、房地产周期和产能周期的末端, 被动补库存、房地产调控、产能去化会给中国经济增长和结构调整带来压力。展望 2017 年下半年, 受房地产周期下行和调控影响, 房地产投资增速将下降, 基础设施投资也会受到资金供给的影响。在出口和消费保持稳定增长的情况下, 受投资增速回调的影响, 中国经济增速将放缓, 但全年实现 6.5% 的增长目标无忧。

下半年我们继续看好大盘蓝筹股持续表现和有确定业绩的新兴成长股的反弹。中长期看市场结构将进一步分化, 缺乏内生增长支撑的高估值个股将面临估值回归, 依赖内生增长、重视股东权益的上市公司将享受市场溢价和政策红利。

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验的描述

(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 70, 734, 754. 94 元, 期末基金份额净值 1. 296 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

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

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）2017 年半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 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	17,795,776.87	16,076,936.00
结算备付金		89,916.26	19,484.90
存出保证金		10,604.73	35,883.53
交易性金融资产	6.4.7.2	294,156,915.14	253,384,539.83
其中：股票投资		294,156,915.14	253,384,539.83
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		-	58,822.90
应收利息	6.4.7.5	3,049.11	3,205.65
应收股利		-	-
应收申购款		94,803.50	251,820.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		312,151,065.61	269,830,693.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		1,159,685.35	-
应付赎回款		536,611.87	120,380.87
应付管理人报酬		175,552.92	173,229.06
应付托管费		35,110.61	34,645.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	102,014.29	82,179.39
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	453,872.60	560,262.61
负债合计		2,462,847.64	970,697.74
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	238,953,463.03	209,606,407.20
未分配利润	6.4.7.10	70,734,754.94	59,253,588.47
所有者权益合计		309,688,217.97	268,859,995.67
负债和所有者权益总计		312,151,065.61	269,830,693.41

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.296 元，基金份额总额 238,953,463.03 份。

6.2 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		6,154,398.77	-59,336,355.98
1.利息收入		56,578.35	75,584.13
其中：存款利息收入	6.4.7.11	56,578.35	75,475.09
债券利息收入		-	109.04
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）		8,776,063.01	-23,573,111.71
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,297,689.55	-25,348,330.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	13,317.35
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	1,478,373.46	1,761,901.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,703,521.98	-35,950,950.24
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	25,279.39	112,121.84
减：二、费用		1,757,944.72	2,386,506.01
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,020,277.43	1,130,250.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	204,055.53	226,050.20

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	229,940.27	725,468.74
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	303,671.49	304,736.08
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		4,396,454.05	-61,722,861.99
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		4,396,454.05	-61,722,861.99

6.3 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: 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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)	209,606,407.20	59,253,588.47	268,859,995.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	4,396,454.05	4,396,454.05
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)	29,347,055.83	7,084,712.42	36,431,768.25
其中: 1. 基金申购款	56,312,629.98	15,482,355.49	71,794,985.47
2. 基金赎回款	-26,965,574.15	-8,397,643.07	-35,363,217.22
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)	238,953,463.03	70,734,754.94	309,688,217.97
项目	上年度可比期间 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)	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)	-	-61,722,861.99	-61,722,861.99
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)	10,508,779.24	-1,264,700.18	9,244,079.06
其中: 1.基金申购款	90,564,061.57	15,685,094.90	106,249,156.47
2.基金赎回款	-80,055,282.33	-16,949,795.08	-97,005,077.41
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)	249,527,373.78	55,086,918.95	304,614,292.73

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:

_____ 邓召明 _____	_____ 高鹏 _____	_____ 郝文高 _____
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%。

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》、《鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)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 2017 年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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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。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。

(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。

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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	17,795,776.87
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	17,795,776.87

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	298,885,336.85	294,156,915.14	-4,728,421.71
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	298,885,336.85	294,156,915.14	-4,728,421.71

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截止本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

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：截止本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截止本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,008.43
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	36.45
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	4.23
合计	3,049.11

6.4.7.6 其他资产

注：截止本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	102,014.29
银行间市场应付交易费用	-
合计	102,014.29

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	557.11
预提费用	403,315.49
指数使用费	50,000.00
合计	453,872.60

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	209,606,407.20	209,606,407.20
本期申购	56,312,629.98	56,312,629.98
本期赎回(以“-”号填列)	-26,965,574.15	-26,965,574.15
- 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	238,953,463.03	238,953,463.03

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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	163,438,740.36	-104,185,151.89	59,253,588.47
本期利润	7,099,976.03	-2,703,521.98	4,396,454.05
本期基金份额交易产生的变动数	23,842,649.29	-16,757,936.87	7,084,712.42
其中：基金申购款	45,493,779.61	-30,011,424.12	15,482,355.49
基金赎回款	-21,651,130.32	13,253,487.25	-8,397,643.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	194,381,365.68	-123,646,610.74	70,734,754.94

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	55,530.68
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	864.36
其他	183.31
合计	56,578.35

注：其他为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	66,271,248.43
减：卖出股票成本总额	58,973,558.88
买卖股票差价收入	7,297,689.55

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**

注：无。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 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 贵金属投资收益项目构成**

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

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。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,478,373.46

基金投资产生的股利收益	-
合计	1,478,373.46

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,703,521.98
——股票投资	-2,703,521.98
——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	-2,703,521.98

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	22,016.15
转换费收入	3,263.24
合计	25,279.39

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	229,940.27
银行间市场交易费用	-
合计	229,940.27

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,767.52
上市年费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
银行汇划费用	356.00
合计	303,671.49

6.4.7.21 分部报告

无。

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、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

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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	-	-	228,724,688.99	47.11%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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	-	-	14,593.60	10.04%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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	213,016.07	47.61%	158,622.05	50.52%

注：(1) 佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1%-买(卖)经手费-买(卖)证管费

深圳证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1%-买(卖)经手费-买(卖)证管费

(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《证券交易单元租用协

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。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,020,277.43	1,130,250.99
其中：支付销售机构的客户维护费	271,895.17	272,789.47

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	204,055.53	226,050.20

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。

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：本基金本报告期及上年度可比期间没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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
工商银行	17,795,776.87	55,530.68	15,574,785.63	70,871.25

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

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-

		日	10 日							
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

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
000061	农产品	2017 年 6 月 28 日	重大事项	9.06	-	-	49,800	452,745.84	451,188.00	-
000099	中信海直	2017 年 5 月 4 日	重大事项	11.26	-	-	30,722	420,025.82	345,929.72	-
000656	金科股份	2017 年 5 月 5 日	重大事项	6.89	2017 年 7 月 5 日	5.92	220,400	931,876.76	1,518,556.00	-
000693	*ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大事项	13.90	-	-	19,205	382,557.31	266,949.50	-
002013	中航机电	2017 年 5 月 12 日	重大事	10.33	2017 年 8 月 2 日	11.36	69,565	678,219.76	718,606.45	-

		日	项		日						
002025	航天 电器	2016 年 9 月 12 日	重 大 事 项	23.69	2017 年 7 月 4 日	22.46	20,267	488,078.86	480,125.23	-	
002122	天马 股份	2017 年 4 月 24 日	重 大 事 项	9.67	2017 年 7 月 24 日	11.15	34,137	244,807.14	330,104.79	-	
002127	南极 电商	2017 年 6 月 29 日	重 大 事 项	12.08	2017 年 7 月 6 日	12.61	56,500	704,392.00	682,520.00	-	
002128	露天 煤业	2017 年 3 月 17 日	重 大 事 项	8.17	2017 年 8 月 14 日	9.57	47,500	399,207.17	388,075.00	-	
002168	深圳 惠程	2017 年 1 月 23 日	重 大 事 项	16.99	-	-	53,434	729,695.86	907,843.66	-	
002358	森源 电气	2017 年 5 月 12 日	重 大 事 项	17.02	2017 年 7 月 12 日	16.68	26,212	462,052.91	446,128.24	-	
002399	海普 瑞	2017 年 4 月 28 日	重 大 事 项	20.23	-	-	27,000	489,760.88	546,210.00	-	
002505	大康 农业	2017 年 3 月 13 日	重 大 事 项	3.50	-	-	119,070	446,629.20	416,745.00	-	
002642	荣之 联	2017 年 4 月 10 日	重 大 事 项	25.06	2017 年 7 月 7 日	22.54	18,200	508,176.21	456,092.00	-	
002681	奋达 科技	2017 年 6 月 22 日	重 大 事 项	12.59	2017 年 7 月 3 日	12.70	27,468	443,456.89	345,822.12	-	
300088	长信 科技	2016 年 9 月 12 日	重 大 事 项	15.75	2017 年 8 月 9 日	14.50	63,700	875,101.69	1,003,275.00	-	

		日	项		日						
300134	大富科技	2017年2月9日	重大事项	23.36	-	-	24,830	745,457.30	580,028.80	-	-
300291	华录百纳	2017年4月19日	重大事项	20.02	-	-	23,617	697,901.10	472,812.34	-	-
300612	宣亚国际	2017年4月11日	重大事项	66.33	-	-	750	8,070.00	49,747.50	-	-
600277	亿利洁能	2017年3月6日	重大事项	7.83	-	-	53,800	336,489.41	421,254.00	-	-
600289	亿阳信通	2017年5月10日	重大事项	10.94	2017年8月18日	12.03	32,107	482,756.79	351,250.58	-	-
600460	士兰微	2017年5月12日	重大事项	6.07	2017年8月15日	6.68	54,169	391,008.04	328,805.83	-	-
600468	百利电气	2017年5月16日	重大事项	6.50	-	-	23,426	216,261.96	152,269.00	-	-
600545	新疆城建	2017年6月22日	重大事项	11.96	2017年7月3日	12.44	39,642	416,008.66	474,118.32	-	-
600643	爱建集团	2017年4月17日	重大事项	14.98	2017年8月2日	16.48	103,672	1,192,547.87	1,553,006.56	-	-
600655	豫园商城	2016年12月20日	重大事项	11.32	-	-	63,300	829,876.52	716,556.00	-	-
600657	信达地产	2017年2月20日	重大事	5.76	2017年8月10日	6.19	49,434	258,993.60	284,739.84	-	-

		日	项		日					
600673	东阳光科	2016年11月15日	重大事件	6.54	-	-	118,649	874,524.37	775,964.46	-
601001	大同煤业	2017年6月22日	重大事件	5.25	2017年7月21日	5.78	61,400	380,593.00	322,350.00	-
601717	郑煤机	2017年4月24日	重大事件	7.79	-	-	54,605	354,107.97	425,372.95	-

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

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。

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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2016 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	17,795,776.87	-	-	-	17,795,776.87
结算备付金	89,916.26	-	-	-	89,916.26
存出保证金	10,604.73	-	-	-	10,604.73
交易性金融资产	-	-	-	294,156,915.14	294,156,915.14
应收利息	-	-	-	3,049.11	3,049.11
应收申购款	-	-	-	94,803.50	94,803.50
资产总计	17,896,297.86	-	-	294,254,767.75	312,151,065.61
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,159,685.35	1,159,685.35
应付赎回款	-	-	-	536,611.87	536,611.87
应付管理人报酬	-	-	-	175,552.92	175,552.92
应付托管费	-	-	-	35,110.61	35,110.61
应付交易费用	-	-	-	102,014.29	102,014.29
其他负债	-	-	-	453,872.60	453,872.60
负债总计	-	-	-	2,462,847.64	2,462,847.64
利率敏感度缺口	17,896,297.86	-	-	-291,791,920.11	309,688,217.97
上年度末 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

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 2017 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%。

（2016 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（2016 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均以人民币计价，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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	294,156,915.14	94.98	253,384,539.83	94.24
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	294,156,915.14	94.98	253,384,539.83	94.24

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 (2017 年 6 月 30 日)	上年度末 (2016 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	15,521,698.69	13,701,496.30
	业绩比较基准下降 5%	-15,521,698.69	-13,701,496.30

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外,根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。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 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	294,156,915.14	94.24
	其中：股票	294,156,915.14	94.24
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	17,885,693.13	5.73
7	其他各项资产	108,457.34	0.03
8	合计	312,151,065.61	100.00

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	3,708,957.70	1.20
B	采矿业	9,493,784.27	3.07
C	制造业	183,376,494.62	59.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,108,245.19	3.26
E	建筑业	6,652,001.26	2.15
F	批发和零售业	14,730,377.15	4.76
G	交通运输、仓储和邮政业	7,819,931.78	2.53
H	住宿和餐饮业	319,780.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,207,960.00	6.53
J	金融业	4,457,955.00	1.44
K	房地产业	18,041,498.07	5.83
L	租赁和商务服务业	5,573,541.74	1.80
M	科学研究和技术服务业	715,759.57	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	2,555,545.18	0.83
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	349,587.00	0.11
Q	卫生和社会工作	755,669.20	0.24
R	文化、体育和娱乐业	3,410,437.21	1.10
S	综合	1,356,479.55	0.44
	合计	293,634,004.49	94.82

7.2.2 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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	327,327.54	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.00
J	金融业	187,943.49	0.06
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	522,910.65	0.17

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

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	300136	信维通信	57,700	2,309,154.00	0.75
2	002460	赣锋锂业	38,700	1,789,875.00	0.58
3	600487	亨通光电	63,772	1,788,804.60	0.58
4	002572	索菲亚	40,700	1,668,700.00	0.54
5	600201	生物股份	45,000	1,600,650.00	0.52
6	600643	爱建集团	103,672	1,553,006.56	0.50
7	000656	金科股份	220,400	1,518,556.00	0.49
8	601012	隆基股份	87,924	1,503,500.40	0.49
9	300156	神雾环保	44,500	1,457,820.00	0.47
10	002271	东方雨虹	38,872	1,442,151.20	0.47
11	600176	中国巨石	128,569	1,411,687.62	0.46
12	600219	南山铝业	407,550	1,381,594.50	0.45
13	603799	华友钴业	21,800	1,325,004.00	0.43
14	600525	长园集团	96,697	1,314,112.23	0.42
15	002405	四维图新	65,874	1,301,670.24	0.42
16	600079	人福医药	66,100	1,296,882.00	0.42
17	000661	长春高新	9,964	1,286,452.04	0.42
18	600315	上海家化	39,600	1,285,020.00	0.41
19	000050	深天马 A	61,700	1,269,169.00	0.41
20	600642	申能股份	200,500	1,263,150.00	0.41
21	600584	长电科技	75,941	1,218,853.05	0.39
22	000998	隆平高科	55,302	1,217,750.04	0.39
23	002092	中泰化学	94,568	1,201,013.60	0.39
24	002340	格林美	196,115	1,186,495.75	0.38
25	000066	中国长城	129,691	1,168,515.91	0.38
26	300115	长盈精密	39,785	1,160,926.30	0.37
27	300266	兴源环境	37,300	1,145,856.00	0.37
28	300296	利亚德	59,800	1,124,240.00	0.36
29	000997	新大陆	48,186	1,093,340.34	0.35
30	002050	三花智控	66,162	1,079,763.84	0.35
31	601168	西部矿业	140,000	1,076,600.00	0.35
32	600516	方大炭素	75,700	1,076,454.00	0.35
33	600291	西水股份	48,200	1,060,400.00	0.34

34	600879	航天电子	119,816	1,053,182.64	0.34
35	002422	科伦药业	63,400	1,047,368.00	0.34
36	000786	北新建材	65,624	1,039,484.16	0.34
37	600325	华发股份	124,375	1,038,531.25	0.34
38	600056	中国医药	39,194	1,017,084.30	0.33
39	002407	多氟多	46,100	1,013,739.00	0.33
40	300088	长信科技	63,700	1,003,275.00	0.32
41	600266	北京城建	69,000	1,003,260.00	0.32
42	000039	中集集团	55,600	1,002,468.00	0.32
43	600022	山东钢铁	482,250	993,435.00	0.32
44	000778	新兴铸管	146,500	981,550.00	0.32
45	600839	四川长虹	271,100	981,382.00	0.32
46	600426	华鲁恒升	83,267	977,554.58	0.32
47	600388	龙净环保	62,800	975,284.00	0.31
48	600166	福田汽车	342,800	973,552.00	0.31
49	600161	天坛生物	24,627	955,773.87	0.31
50	000581	威孚高科	36,900	955,710.00	0.31
51	600435	北方导航	65,572	938,335.32	0.30
52	600528	中铁工业	65,200	931,708.00	0.30
53	002410	广联达	49,300	926,840.00	0.30
54	000970	中科三环	62,600	925,228.00	0.30
55	000999	华润三九	28,700	911,225.00	0.29
56	002217	合力泰	91,900	907,972.00	0.29
57	002168	深圳惠程	53,434	907,843.66	0.29
58	002179	中航光电	29,014	904,946.66	0.29
59	002366	台海核电	19,100	895,981.00	0.29
60	600138	中青旅	42,516	895,386.96	0.29
61	600600	青岛啤酒	25,500	895,050.00	0.29
62	600699	均胜电子	27,842	893,449.78	0.29
63	000028	国药一致	10,957	886,421.30	0.29
64	002573	清新环境	46,952	883,636.64	0.29
65	002038	双鹭药业	30,200	880,330.00	0.28
66	600978	宜华生活	87,054	874,892.70	0.28
67	601000	唐山港	167,360	873,619.20	0.28
68	002223	鱼跃医疗	36,805	871,542.40	0.28
69	600260	凯乐科技	34,259	868,123.06	0.28
70	300383	光环新网	63,700	863,772.00	0.28
71	600521	华海药业	40,913	860,809.52	0.28
72	600614	鹏起科技	77,688	854,568.00	0.28

73	603589	口子窖	22,000	853,380.00	0.28
74	002311	海大集团	46,480	849,189.60	0.27
75	600158	中体产业	49,571	847,664.10	0.27
76	000488	晨鸣纸业	65,406	843,737.40	0.27
77	300002	神州泰岳	100,800	840,672.00	0.27
78	002583	海能达	51,300	825,417.00	0.27
79	000878	云南铜业	62,400	823,056.00	0.27
80	300113	顺网科技	30,561	822,090.90	0.27
81	002078	太阳纸业	111,694	820,950.90	0.27
82	300055	万邦达	44,500	818,800.00	0.26
83	002004	华邦健康	104,535	818,509.05	0.26
84	600511	国药股份	22,492	815,110.08	0.26
85	600503	华丽家族	117,600	812,616.00	0.26
86	002030	达安基因	37,267	812,047.93	0.26
87	002019	亿帆医药	48,500	808,980.00	0.26
88	002273	水晶光电	38,946	803,455.98	0.26
89	000400	许继电气	44,400	797,424.00	0.26
90	603019	中科曙光	28,300	796,362.00	0.26
91	002244	滨江集团	114,192	790,208.64	0.26
92	600392	盛和资源	59,522	785,095.18	0.25
93	600298	安琪酵母	30,218	781,739.66	0.25
94	000566	海南海药	58,854	780,404.04	0.25
95	600755	厦门国贸	85,513	779,878.56	0.25
96	002384	东山精密	31,456	776,963.20	0.25
97	002001	新和成	40,000	776,400.00	0.25
98	600673	东阳光科	118,649	775,964.46	0.25
99	600808	马钢股份	219,100	775,614.00	0.25
100	600635	大众公用	142,087	774,374.15	0.25
101	300324	旋极信息	42,200	769,728.00	0.25
102	600717	天津港	61,500	768,135.00	0.25
103	000547	航天发展	73,500	768,075.00	0.25
104	000930	中粮生化	70,847	763,730.66	0.25
105	600409	三友化工	75,802	763,326.14	0.25
106	000401	冀东水泥	49,500	761,805.00	0.25
107	600240	华业资本	83,654	757,905.24	0.24
108	000418	小天鹅A	16,159	756,079.61	0.24
109	300244	迪安诊断	24,020	755,669.20	0.24
110	002176	江特电机	86,300	752,536.00	0.24
111	601231	环旭电子	47,900	752,509.00	0.24

112	600122	宏图高科	67,782	752,380.20	0.24
113	600872	中炬高新	40,978	749,897.40	0.24
114	002491	通鼎互联	55,600	747,264.00	0.24
115	600160	巨化股份	62,000	745,860.00	0.24
116	300146	汤臣倍健	54,000	741,960.00	0.24
117	000598	兴蓉环境	131,500	739,030.00	0.24
118	300058	蓝色光标	94,400	738,208.00	0.24
119	600633	浙数文化	38,200	738,024.00	0.24
120	000960	锡业股份	54,000	734,940.00	0.24
121	002439	启明星辰	39,500	734,700.00	0.24
122	002601	龙麟佰利	44,800	733,824.00	0.24
123	600418	江淮汽车	69,468	732,887.40	0.24
124	600500	中化国际	76,500	731,340.00	0.24
125	600062	华润双鹤	26,600	729,638.00	0.24
126	000825	太钢不锈	167,300	727,755.00	0.23
127	300159	新研股份	54,700	724,228.00	0.23
128	002408	齐翔腾达	65,181	722,205.48	0.23
129	600143	金发科技	119,700	721,791.00	0.23
130	002400	省广股份	89,546	719,054.38	0.23
131	002013	中航机电	69,565	718,606.45	0.23
132	600655	豫园商城	63,300	716,556.00	0.23
133	000685	中山公用	64,974	711,465.30	0.23
134	002354	天神娱乐	33,020	709,930.00	0.23
135	600594	益佰制药	46,500	709,590.00	0.23
136	000089	深圳机场	75,300	704,055.00	0.23
137	000078	海王生物	116,677	703,562.31	0.23
138	000513	丽珠集团	10,248	697,888.80	0.23
139	000729	燕京啤酒	103,500	695,520.00	0.22
140	000979	中弘股份	263,984	691,638.08	0.22
141	601699	潞安环能	87,800	686,596.00	0.22
142	600312	平高电气	49,812	684,416.88	0.22
143	600811	东方集团	104,900	683,948.00	0.22
144	002127	南极电商	56,500	682,520.00	0.22
145	000926	福星股份	55,725	679,845.00	0.22
146	600884	杉杉股份	41,246	679,321.62	0.22
147	600881	亚泰集团	133,468	678,017.44	0.22
148	600566	济川药业	17,800	676,934.00	0.22
149	002051	中工国际	32,632	676,461.36	0.22
150	600967	内蒙一机	49,600	676,048.00	0.22

151	000697	炼石有色	32,877	672,992.19	0.22
152	300122	智飞生物	35,200	672,672.00	0.22
153	601880	大连港	227,222	672,577.12	0.22
154	600970	中材国际	77,250	671,302.50	0.22
155	002640	跨境通	31,500	669,375.00	0.22
156	000690	宝新能源	111,860	668,922.80	0.22
157	002431	棕榈股份	60,680	668,693.60	0.22
158	000988	华工科技	45,750	667,492.50	0.22
159	600026	中远海能	100,456	666,023.28	0.22
160	600120	浙江东方	24,687	663,586.56	0.21
161	002373	千方科技	48,614	663,094.96	0.21
162	002701	奥瑞金	103,753	662,981.67	0.21
163	600809	山西汾酒	19,100	662,579.00	0.21
164	600499	科达洁能	82,900	658,226.00	0.21
165	600183	生益科技	53,252	657,129.68	0.21
166	600307	酒钢宏兴	229,900	655,215.00	0.21
167	000806	银河生物	48,500	654,750.00	0.21
168	002390	信邦制药	75,087	654,007.77	0.21
169	600664	哈药股份	111,960	650,487.60	0.21
170	002048	宁波华翔	31,172	650,247.92	0.21
171	002512	达华智能	40,200	649,230.00	0.21
172	002221	东华能源	59,418	648,250.38	0.21
173	000600	建投能源	52,600	645,402.00	0.21
174	300253	卫宁健康	82,185	641,864.85	0.21
175	600863	内蒙华电	213,200	641,732.00	0.21
176	600094	大名城	83,600	641,212.00	0.21
177	600787	中储股份	80,734	638,605.94	0.21
178	600572	康恩贝	92,177	637,864.84	0.21
179	000012	南玻A	67,504	629,812.32	0.20
180	002191	劲嘉股份	67,124	628,280.64	0.20
181	000592	平潭发展	113,500	626,520.00	0.20
182	600874	创业环保	31,939	625,046.23	0.20
183	002665	首航节能	86,805	624,996.00	0.20
184	002635	安洁科技	17,253	624,903.66	0.20
185	300026	红日药业	132,600	624,546.00	0.20
186	002028	思源电气	39,024	622,042.56	0.20
187	000667	美好置业	187,891	621,919.21	0.20
188	300166	东方国信	46,219	620,721.17	0.20
189	000816	智慧农业	83,361	620,205.84	0.20

190	002603	以岭药业	35,400	618,084.00	0.20
191	002444	巨星科技	39,495	615,332.10	0.20
192	600478	科力远	71,448	615,167.28	0.20
193	300001	特锐德	36,600	613,416.00	0.20
194	002477	雏鹰农牧	138,112	611,836.16	0.20
195	000006	深振业 A	69,407	611,475.67	0.20
196	600017	日照港	135,507	609,781.50	0.20
197	000732	泰禾集团	36,500	608,820.00	0.20
198	000758	中色股份	86,800	608,468.00	0.20
199	000975	银泰资源	47,686	602,274.18	0.19
200	000031	中粮地产	79,883	601,518.99	0.19
201	600125	铁龙物流	67,063	600,884.48	0.19
202	603077	和邦生物	117,900	600,111.00	0.19
203	600064	南京高科	39,739	600,058.90	0.19
204	600348	阳泉煤业	88,300	598,674.00	0.19
205	002672	东江环保	35,337	596,841.93	0.19
206	000158	常山股份	37,300	589,340.00	0.19
207	600565	迪马股份	106,900	589,019.00	0.19
208	000939	凯迪生态	115,444	588,764.40	0.19
209	000027	深圳能源	87,300	587,529.00	0.19
210	000563	陕国投 A	113,432	586,443.44	0.19
211	000860	顺鑫农业	29,288	586,052.88	0.19
212	002250	联化科技	40,749	582,710.70	0.19
213	300287	飞利信	63,200	580,176.00	0.19
214	300134	大富科技	24,830	580,028.80	0.19
215	600198	大唐电信	45,296	578,429.92	0.19
216	600597	光明乳业	45,200	576,300.00	0.19
217	300116	坚瑞沃能	53,600	576,200.00	0.19
218	300274	阳光电源	51,940	576,014.60	0.19
219	600410	华胜天成	64,834	574,429.24	0.19
220	000877	天山股份	45,248	573,292.16	0.19
221	002261	拓维信息	48,900	572,619.00	0.18
222	002468	申通快递	22,500	571,725.00	0.18
223	600416	湘电股份	41,621	570,207.70	0.18
224	002308	威创股份	43,559	568,444.95	0.18
225	002266	浙富控股	116,240	567,251.20	0.18
226	000727	华东科技	199,500	564,585.00	0.18
227	603766	隆鑫通用	77,518	564,331.04	0.18
228	600687	刚泰控股	43,700	562,856.00	0.18

229	600200	江苏吴中	42,394	559,600.80	0.18
230	600582	天地科技	121,500	557,685.00	0.18
231	002002	鸿达兴业	71,138	557,010.54	0.18
232	002353	杰瑞股份	35,200	556,864.00	0.18
233	002517	恺英网络	15,800	556,002.00	0.18
234	600039	四川路桥	133,050	553,488.00	0.18
235	601929	吉视传媒	159,900	553,254.00	0.18
236	601928	凤凰传媒	56,100	547,536.00	0.18
237	002399	海普瑞	27,000	546,210.00	0.18
238	600466	蓝光发展	62,700	541,101.00	0.17
239	600282	南钢股份	145,400	539,434.00	0.17
240	000712	锦龙股份	32,900	538,573.00	0.17
241	600751	天海投资	94,500	537,705.00	0.17
242	002396	星网锐捷	27,737	536,710.95	0.17
243	601689	拓普集团	16,000	535,840.00	0.17
244	600086	东方金钰	49,522	535,332.82	0.17
245	603000	人民网	40,600	534,702.00	0.17
246	300257	开山股份	25,200	531,216.00	0.17
247	600380	健康元	58,261	529,009.88	0.17
248	600557	康缘药业	31,690	526,370.90	0.17
249	002375	亚厦股份	59,000	525,690.00	0.17
250	002670	国盛金控	32,960	524,064.00	0.17
251	002022	科华生物	30,154	523,774.98	0.17
252	000501	鄂武商 A	28,285	522,141.10	0.17
253	000830	鲁西化工	75,327	519,756.30	0.17
254	600151	航天机电	63,143	519,666.89	0.17
255	000519	中兵红箭	41,208	519,220.80	0.17
256	002268	卫士通	30,780	517,719.60	0.17
257	002544	杰赛科技	22,700	517,560.00	0.17
258	300199	翰宇药业	33,700	516,958.00	0.17
259	002440	闰土股份	33,774	515,391.24	0.17
260	002281	光迅科技	23,060	512,393.20	0.17
261	002589	瑞康医药	33,110	509,894.00	0.16
262	002489	浙江永强	79,829	509,309.02	0.16
263	600169	太原重工	131,800	508,748.00	0.16
264	000703	恒逸石化	35,706	508,453.44	0.16
265	002368	太极股份	18,341	507,862.29	0.16
266	600316	洪都航空	31,600	507,812.00	0.16
267	002155	湖南黄金	53,000	507,210.00	0.16

268	600611	大众交通	91,787	506,664.24	0.16
269	600366	宁波韵升	28,680	505,915.20	0.16
270	600270	外运发展	26,622	503,954.46	0.16
271	600759	洲际油气	83,099	503,579.94	0.16
272	600694	大商股份	12,900	502,713.00	0.16
273	002657	中科金财	17,300	501,527.00	0.16
274	600835	上海机电	23,646	499,876.44	0.16
275	000528	柳工	57,800	499,392.00	0.16
276	600267	海正药业	42,500	496,400.00	0.16
277	002342	巨力索具	49,288	496,330.16	0.16
278	000612	焦作万方	61,262	493,159.10	0.16
279	600108	亚盛集团	114,400	493,064.00	0.16
280	300273	和佳股份	40,470	492,115.20	0.16
281	600187	国中水务	97,100	490,355.00	0.16
282	600563	法拉电子	9,923	490,295.43	0.16
283	002709	天赐材料	11,900	489,923.00	0.16
284	000090	天健集团	44,004	488,444.40	0.16
285	600645	中源协和	22,699	486,439.57	0.16
286	601678	滨化股份	69,792	485,054.40	0.16
287	002503	搜于特	68,820	483,804.60	0.16
288	002285	世联行	60,100	482,002.00	0.16
289	600993	马应龙	22,124	481,860.72	0.16
290	600848	上海临港	22,300	480,788.00	0.16
291	002025	航天电器	20,267	480,125.23	0.16
292	600729	重庆百货	17,871	479,657.64	0.15
293	000937	冀中能源	77,800	476,136.00	0.15
294	600098	广州发展	60,000	474,600.00	0.15
295	600545	新疆城建	39,642	474,118.32	0.15
296	300291	华录百纳	23,617	472,812.34	0.15
297	600765	中航重机	34,295	472,585.10	0.15
298	002437	誉衡药业	64,555	469,960.40	0.15
299	002325	洪涛股份	63,950	466,835.00	0.15
300	000049	德赛电池	9,008	466,704.48	0.15
301	000587	金洲慈航	31,182	464,611.80	0.15
302	000021	深科技	54,056	463,800.48	0.15
303	000810	创维数字	38,000	460,940.00	0.15
304	600073	上海梅林	48,176	460,080.80	0.15
305	300376	易事特	50,700	459,849.00	0.15
306	000543	皖能电力	78,851	459,701.33	0.15

307	600422	昆药集团	40,514	459,428.76	0.15
308	600300	维维股份	85,922	458,823.48	0.15
309	002011	盾安环境	40,405	458,596.75	0.15
310	002018	华信国际	66,900	458,265.00	0.15
311	600750	江中药业	13,182	458,074.50	0.15
312	002249	大洋电机	69,550	457,639.00	0.15
313	000829	天音控股	42,297	456,807.60	0.15
314	002642	荣之联	18,200	456,092.00	0.15
315	000766	通化金马	28,400	453,832.00	0.15
316	603444	吉比特	1,600	453,328.00	0.15
317	600639	浦东金桥	25,011	453,199.32	0.15
318	000669	金鸿能源	24,966	452,633.58	0.15
319	002056	横店东磁	60,308	452,310.00	0.15
320	000061	农产品	49,800	451,188.00	0.15
321	000777	中核科技	22,545	449,998.20	0.15
322	601016	节能风电	122,000	448,960.00	0.14
323	000636	风华高科	52,600	447,626.00	0.14
324	000897	津滨发展	95,022	446,603.40	0.14
325	002358	森源电气	26,212	446,128.24	0.14
326	002317	众生药业	35,902	445,902.84	0.14
327	603188	亚邦股份	25,400	442,976.00	0.14
328	601311	骆驼股份	31,154	441,140.64	0.14
329	000572	海马汽车	84,501	436,870.17	0.14
330	600284	浦东建设	40,706	436,368.32	0.14
331	000762	西藏矿业	30,590	433,460.30	0.14
332	600651	飞乐音响	50,991	431,893.77	0.14
333	600259	广晟有色	11,031	430,650.24	0.14
334	000848	承德露露	43,086	429,998.28	0.14
335	600770	综艺股份	57,275	429,562.50	0.14
336	600496	精工钢构	88,723	428,532.09	0.14
337	000596	古井贡酒	8,400	427,980.00	0.14
338	601717	郑煤机	54,605	425,372.95	0.14
339	600587	新华医疗	23,873	424,461.94	0.14
340	002123	梦网荣信	38,000	422,180.00	0.14
341	000062	深圳华强	15,900	421,827.00	0.14
342	600277	亿利洁能	53,800	421,254.00	0.14
343	002106	莱宝高科	41,500	420,395.00	0.14
344	600216	浙江医药	42,400	420,184.00	0.14
345	002479	富春环保	35,106	417,761.40	0.13

346	002276	万马股份	41,401	417,736.09	0.13
347	600536	中国软件	21,775	417,209.00	0.13
348	002254	泰和新材	31,344	416,875.20	0.13
349	002505	大康农业	119,070	416,745.00	0.13
350	002064	华峰氨纶	86,222	415,590.04	0.13
351	300010	立思辰	32,000	414,400.00	0.13
352	002428	云南锗业	38,378	409,877.04	0.13
353	002482	广田集团	45,537	409,377.63	0.13
354	002073	软控股份	48,214	408,854.72	0.13
355	002707	众信旅游	31,000	407,030.00	0.13
356	002332	仙琚制药	47,127	405,292.20	0.13
357	600458	时代新材	35,390	405,215.50	0.13
358	002242	九阳股份	20,541	404,041.47	0.13
359	600171	上海贝岭	39,562	402,345.54	0.13
360	000652	泰达股份	75,804	401,761.20	0.13
361	000680	山推股份	72,877	397,179.65	0.13
362	000620	新华联	55,733	396,261.63	0.13
363	000969	安泰科技	45,174	394,369.02	0.13
364	000541	佛山照明	43,106	392,695.66	0.13
365	600428	中远海特	63,022	391,996.84	0.13
366	002463	沪电股份	86,019	391,386.45	0.13
367	000726	鲁 泰 A	32,962	390,929.32	0.13
368	600058	五矿发展	31,500	390,915.00	0.13
369	002128	露天煤业	47,500	388,075.00	0.13
370	001696	宗申动力	50,445	381,868.65	0.12
371	002690	美亚光电	19,900	381,682.00	0.12
372	603883	老百姓	7,800	379,470.00	0.12
373	600329	中新药业	20,862	377,810.82	0.12
374	300297	蓝盾股份	34,500	377,775.00	0.12
375	600517	置信电气	49,832	377,228.24	0.12
376	601233	桐昆股份	27,169	376,562.34	0.12
377	300043	星辉娱乐	45,700	375,197.00	0.12
378	600894	广日股份	31,562	373,694.08	0.12
379	603888	新华网	11,500	372,485.00	0.12
380	600736	苏州高新	52,613	371,973.91	0.12
381	000426	兴业矿业	41,140	371,082.80	0.12
382	601777	力帆股份	46,128	370,869.12	0.12
383	603556	海兴电力	8,400	368,676.00	0.12
384	002063	远光软件	35,305	367,878.10	0.12

385	600859	王府井	22,749	367,396.35	0.12
386	600805	悦达投资	49,975	367,316.25	0.12
387	600880	博瑞传播	56,200	366,986.00	0.12
388	600586	金晶科技	74,968	366,593.52	0.12
389	600790	轻纺城	53,760	366,105.60	0.12
390	600338	西藏珠峰	9,600	364,704.00	0.12
391	603369	今世缘	27,600	364,320.00	0.12
392	000616	海航投资	84,040	361,372.00	0.12
393	000552	靖远煤电	100,718	359,563.26	0.12
394	600220	江苏阳光	104,758	359,319.94	0.12
395	603816	顾家家居	6,100	358,558.00	0.12
396	002663	普邦股份	65,878	357,717.54	0.12
397	600720	祁连山	45,554	356,687.82	0.12
398	600395	盘江股份	48,600	356,238.00	0.12
399	600773	西藏城投	32,165	356,066.55	0.11
400	002727	一心堂	19,128	351,955.20	0.11
401	600289	亿阳信通	32,107	351,250.58	0.11
402	603377	东方时尚	9,300	349,587.00	0.11
403	300147	香雪制药	33,946	348,625.42	0.11
404	601886	江河集团	33,900	347,475.00	0.11
405	603355	莱克电气	5,900	346,743.00	0.11
406	000099	中信海直	30,722	345,929.72	0.11
407	002681	奋达科技	27,468	345,822.12	0.11
408	002120	韵达股份	6,700	345,720.00	0.11
409	002269	美邦服饰	92,200	343,906.00	0.11
410	600006	东风汽车	58,743	343,646.55	0.11
411	002041	登海种业	25,890	343,042.50	0.11
412	300039	上海凯宝	47,179	342,991.33	0.11
413	002005	德豪润达	71,730	342,152.10	0.11
414	002190	成飞集成	12,700	340,360.00	0.11
415	600801	华新水泥	35,707	340,287.71	0.11
416	002345	潮宏基	31,034	337,339.58	0.11
417	600596	新安股份	39,850	336,732.50	0.11
418	002277	友阿股份	51,982	335,283.90	0.11
419	603198	迎驾贡酒	17,600	334,928.00	0.11
420	600280	中央商场	42,132	334,106.76	0.11
421	300032	金龙机电	23,900	333,405.00	0.11
422	600757	长江传媒	44,544	332,743.68	0.11
423	300202	聚龙股份	20,122	332,415.44	0.11

424	600053	九鼎投资	9,500	332,120.00	0.11
425	000417	合肥百货	40,049	330,404.25	0.11
426	002122	天马股份	34,137	330,104.79	0.11
427	600059	古越龙山	35,588	329,189.00	0.11
428	600628	新世界	28,469	328,816.95	0.11
429	600460	士兰微	54,169	328,805.83	0.11
430	600869	智慧能源	48,854	328,787.42	0.11
431	002588	史丹利	42,520	326,978.80	0.11
432	600141	兴发集团	26,348	325,924.76	0.11
433	000681	视觉中国	20,600	322,596.00	0.10
434	600580	卧龙电气	47,286	322,490.52	0.10
435	601001	大同煤业	61,400	322,350.00	0.10
436	002371	北方华创	13,475	322,322.00	0.10
437	002147	新光圆成	20,600	320,124.00	0.10
438	600754	锦江股份	11,800	319,780.00	0.10
439	002233	塔牌集团	26,252	319,486.84	0.10
440	600481	双良节能	59,476	315,817.56	0.10
441	002344	海宁皮城	37,700	313,664.00	0.10
442	600292	远达环保	28,643	308,771.54	0.10
443	600195	中牧股份	15,734	305,082.26	0.10
444	601002	晋亿实业	34,869	301,616.85	0.10
445	600537	亿晶光电	60,428	300,931.44	0.10
446	600971	恒源煤电	36,722	298,549.86	0.10
447	600862	中航高科	30,700	297,483.00	0.10
448	600640	号百控股	17,487	295,530.30	0.10
449	002309	中利集团	23,531	294,372.81	0.10
450	600748	上实发展	40,612	292,406.40	0.09
451	600743	华远地产	68,927	290,871.94	0.09
452	600657	信达地产	49,434	284,739.84	0.09
453	600184	光电股份	14,940	280,274.40	0.09
454	600826	兰生股份	15,428	279,246.80	0.09
455	002699	美盛文化	20,060	276,828.00	0.09
456	600996	贵广网络	23,000	275,310.00	0.09
457	600251	冠农股份	34,530	275,204.10	0.09
458	603169	兰石重装	22,600	274,590.00	0.09
459	600335	国机汽车	22,708	271,587.68	0.09
460	000693	*ST 华泽	19,205	266,949.50	0.09
461	600831	广电网络	26,647	265,137.65	0.09
462	002551	尚荣医疗	16,330	263,402.90	0.09

463	002392	北京利尔	43,960	260,682.80	0.08
464	002093	国脉科技	29,550	260,040.00	0.08
465	002118	紫鑫药业	37,596	256,780.68	0.08
466	002414	高德红外	13,750	251,625.00	0.08
467	002416	爱施德	22,700	244,933.00	0.08
468	600776	东方通信	35,105	238,011.90	0.08
469	000536	华映科技	40,600	235,886.00	0.08
470	002251	步步高	18,999	235,397.61	0.08
471	600551	时代出版	14,861	234,655.19	0.08
472	603005	晶方科技	8,272	231,533.28	0.07
473	002646	青青稞酒	13,236	231,100.56	0.07
474	603698	航天工程	9,100	229,320.00	0.07
475	603001	奥康国际	11,823	222,154.17	0.07
476	000517	荣安地产	46,800	217,620.00	0.07
477	603568	伟明环保	10,050	217,281.00	0.07
478	603868	飞科电器	3,500	216,440.00	0.07
479	603567	珍宝岛	12,500	210,375.00	0.07
480	000025	特力A	4,000	206,960.00	0.07
481	603328	依顿电子	14,608	206,703.20	0.07
482	600936	广西广电	24,500	197,715.00	0.06
483	603528	多伦科技	13,700	196,869.00	0.06
484	600126	杭钢股份	28,600	196,196.00	0.06
485	002807	江阴银行	15,600	195,468.00	0.06
486	603806	福斯特	5,900	188,859.00	0.06
487	600618	氯碱化工	16,498	176,198.64	0.06
488	603228	景旺电子	3,600	173,700.00	0.06
489	002315	焦点科技	6,932	172,884.08	0.06
490	603515	欧普照明	4,700	169,764.00	0.05
491	601020	华钰矿业	7,700	169,631.00	0.05
492	603866	桃李面包	4,600	163,668.00	0.05
493	600468	百利电气	23,426	152,269.00	0.05
494	002194	武汉凡谷	16,534	146,325.90	0.05
495	603658	安图生物	3,100	133,610.00	0.04
496	002815	崇达技术	3,900	128,856.00	0.04
497	002818	富森美	3,200	126,304.00	0.04
498	600917	重庆燃气	12,600	118,818.00	0.04
499	601811	新华文轩	7,600	118,256.00	0.04
500	603877	太平鸟	4,200	117,558.00	0.04
501	000761	本钢板材	22,100	115,583.00	0.04

502	603569	长久物流	3,200	106,976.00	0.03
503	603025	大豪科技	3,600	95,040.00	0.03
504	300612	宣亚国际	750	49,747.50	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

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	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.06
2	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
3	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
4	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
5	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
6	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
7	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
8	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
9	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
10	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
11	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
12	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
13	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
14	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
15	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
16	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
17	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
18	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

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	000066	长城电脑	1,757,819.65	0.65
2	600642	申能股份	1,244,525.00	0.46
3	600521	华海药业	1,066,639.38	0.40
4	000778	新兴铸管	1,044,061.00	0.39

5	603799	华友钴业	1,018,014.00	0.38
6	000039	中集集团	943,573.97	0.35
7	600839	四川长虹	940,815.00	0.35
8	300002	神州泰岳	846,131.79	0.31
9	300383	光环新网	809,909.00	0.30
10	002583	海能达	777,105.12	0.29
11	300058	蓝色光标	764,713.00	0.28
12	600687	刚泰控股	715,783.00	0.27
13	300136	信维通信	708,045.92	0.26
14	002127	南极电商	704,392.00	0.26
15	000729	燕京啤酒	696,889.00	0.26
16	002601	佰利联	688,464.00	0.26
17	600566	济川药业	669,402.31	0.25
18	300146	汤臣倍健	632,995.00	0.24
19	000732	泰禾集团	603,006.00	0.22
20	000027	深圳能源	598,943.02	0.22

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	002508	老板电器	1,490,737.25	0.55
2	600522	中天科技	1,468,383.94	0.55
3	600682	南京新百	1,220,993.00	0.45
4	600436	片仔癀	1,191,705.00	0.44
5	600521	华海药业	1,058,125.00	0.39
6	000887	中鼎股份	962,206.66	0.36
7	000066	长城电脑	787,453.00	0.29
8	000959	首钢股份	777,392.00	0.29
9	002602	世纪华通	772,230.00	0.29
10	600497	驰宏锌锗	750,941.00	0.28
11	600549	厦门钨业	644,354.00	0.24
12	002595	豪迈科技	639,644.44	0.24
13	600601	方正科技	606,855.74	0.23
14	601212	白银有色	575,395.20	0.21
15	000961	中南建设	571,247.82	0.21

16	002242	九阳股份	506,431.00	0.19
17	601881	中国银河	504,235.98	0.19
18	600067	冠城大通	493,272.42	0.18
19	600575	皖江物流	480,274.32	0.18
20	600851	海欣股份	445,564.68	0.17

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	102,449,456.17
卖出股票收入（成交）总额	66,271,248.43

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：本基金本报告期末未持有债券。

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：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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：本基金本报告期末未持有贵金属。

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：本基金本报告期末未持有权证。

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：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

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

本基金投资的前十名证券之一生物股份

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。特此公告。

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。

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	10,604.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,049.11
5	应收申购款	94,803.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	108,457.34

7.12.4 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。

7.12.5 期末股票中存在流通受限情况的说明**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

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	600643	爱建集团	1,553,006.56	0.50	重大事项
2	000656	金科股份	1,518,556.00	0.49	重大事项

7.12.5.2 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	002879	长缆科技	23,660.26	0.01	新股锁定

7.12.6 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。

§ 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

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
13,245	18,041.03	28,373,020.58	11.87%	210,580,442.45	88.13%

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	冷利群	694,024.00	7.95%
2	高炜	290,000.00	3.32%
3	黄月明	277,000.00	3.17%
4	深圳市博凯保健品有限公司	200,028.00	2.29%
5	张宏旭	200,012.00	2.29%
6	施红梅	197,014.00	2.26%
7	卢翠馨	195,030.00	2.23%
8	陈吉荃	150,042.00	1.72%
9	罗丽珊	149,225.00	1.71%
10	鹿敏理	119,003.00	1.36%

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

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	51,468.40	0.02%

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。

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：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。

§ 9 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	209,606,407.20
本报告期基金总申购份额	56,312,629.98
减:本报告期基金总赎回份额	26,965,574.15
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	238,953,463.03

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。

§ 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

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，经公司董事会审议通过，公司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。

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。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	
长江证券	1	84,329,624.09	51.73%	76,850.23	51.20%	-
银河证券	1	77,393,320.52	47.48%	72,078.23	48.02%	-
广发证券	1	1,280,726.80	0.79%	1,167.10	0.78%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	本报告期 内撤销

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。

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

注：无。

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旗下部分基金参与中国工商银行	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时	2017 年 1 月 3 日

	“2017 倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告	报》	
2	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肯特瑞财富投资管理有限公司认\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》	2017 年 1 月 10 日
3	鹏华基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞财富投资管理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》	2017 年 1 月 10 日
4	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》	2017 年 1 月 14 日
5	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购江苏张家港农村商业银行股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 1 月 17 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》	2017 年 1 月 17 日
7	2016 年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 1 月 19 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》	2017 年 2 月 10 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变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 2 月 11 日
10	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》	2017 年 2 月 23 日
11	鹏华基金管理有限公司关于增加民生证券股份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》	2017 年 3 月 1 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》	2017 年 3 月 8 日
13	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》	2017 年 3 月 18 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与浙江同花顺	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 3 月 20 日

	基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	报》	
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》	2017 年 3 月 22 日
16	鹏华基金管理有限公司关于增加南京苏宁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》	2017 年 3 月 22 日
17	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》	2017 年 3 月 23 日
18	基金高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 3 月 23 日
19	鹏华基金管理有限公司关于增加上海华夏财富投资管理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》	2017 年 3 月 30 日
20	2016 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 3 月 30 日
21	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》	2017 年 3 月 31 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》	2017 年 4 月 12 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》	2017 年 4 月 18 日
24	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》	2017 年 4 月 20 日
25	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》	2017 年 4 月 22 日
26	2017 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 24 日
27	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》	2017 年 4 月 25 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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时	2017 年 5 月 9 日

	变更的提示性公告	报》	
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》	2017 年 5 月 11 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》	2017 年 5 月 13 日
31	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》	2017 年 5 月 20 日
32	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》	2017 年 5 月 23 日
33	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》	2017 年 5 月 24 日
34	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购金龙羽首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 6 月 16 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》	2017 年 6 月 27 日
36	鹏华基金管理有限公司关于网上直销交易系统升级切换及启用新版网上直销交易系统的提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 6 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）《鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- （二）《鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- （三）《鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）2017 年半年度报告》（原文）。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行股份有限公司

12.3 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 8 月 28 日