

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

送刊日期:2013年3月29日

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，并由董事长签章。

基金托管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年4月26日复核了本报告期内的财务报表，对表决权分配、费用分摊、财务会计报告、投资组合报告等进行了复核，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金的过往业绩并不代表其未来表现，投资者不能据此判断基金未来的投资收益。

报告期末中大会计师事务所会计师对本报告出具了标准无保留意见的审计报告。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 鹏华中证500指数(LOF)

基金主代码 160616

交易代码 160616

上市交易型开放式(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 1,200,228,393.59份

基金合同存续期 不定期

基金份额净值的计算方法 详见基金合同

上一月度报告期 2010年04月28日

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

2.2 基金产品说明

采用指教化投资方式,追求基金净值增长率与业绩比较基准收益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,以实现对中证500指数的有效跟踪。

本基金采用被动式指数化投资方法,通过严格按照成份股在中证500指数中的权重进行复制,根据成份股的权重变化相应调整组合的构成比例。

当期初股票股息发放时,将根据发放的股息进行相应的调整,并将其从基金资产中扣除。

4.6.1.2 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,本公司将股票停牌等没有市价的股票投资品种估值大小,由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程部等部门共同研究决定。

4.6.2 经理人参与或决定定价的程序

基金经理不参与或决定定价日常估值。

基金经理参与定价小组对股票估值的讨论,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方法。

4.6.4 公司参与定价流程的公司

本公司现设有定价小组对股票估值的定价小组,并由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程部等部门共同研究决定。

4.7 管理人报告期间内基金估值情况的说明

4.7.1 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.2 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.3 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.4 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.5 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.6 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.7 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.8 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.9 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.10 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.11 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.12 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.13 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.14 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.15 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.16 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.17 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.18 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.19 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.20 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.21 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.22 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.23 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.24 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.25 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.26 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.27 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.28 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.29 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.30 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.31 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.32 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.33 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.34 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.35 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.36 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.37 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.38 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.39 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.40 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.41 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.42 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.43 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.44 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.45 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.46 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.47 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.48 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.49 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.50 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.51 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.52 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.53 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.54 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.55 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.56 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.57 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.58 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.59 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.60 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.61 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.62 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.63 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.64 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.65 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.66 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.67 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.68 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.69 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.70 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.71 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.72 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.73 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.74 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.75 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.76 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.77 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.78 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.79 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.80 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.81 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.82 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.83 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.84 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.85 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.86 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.87 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.88 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.89 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.90 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.91 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.92 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.93 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.94 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.95 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.96 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.97 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.98 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.99 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.100 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.101 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.102 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.103 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.104 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.105 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.106 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.107 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.108 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.109 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.110 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.111 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.112 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.113 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.114 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.115 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。

4.7.116 本报告期未发生影响基金估值的重大事件。