普丰证券投资基金

【2013】第四季度报告

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21日

§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。

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2014年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和 运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华普丰封闭
基金主代码	184693
交易代码	184693
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年7月14日
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00份
投资目标	导入指数化投资概念,增加投资广度,分散投资风险,同时贯彻绩优、成长的选股原则。通过指数化投资和优化组合投资两种模式的积极结合,实现风险与收益的有效平衡,力争使基金取得超过市场平均收益率以上的投资收益,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将指数化投资与优化组合投资有机结合,在进一步分散风险的同时,积极投资绩优股和成长股,将基金财产按一定比例分为指数化投资部分、债券投资部分和优化组合投资部分,力争在降低风险的同时,实现基金财产增值。
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

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“基金普丰”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)
1.本期已实现收益	15,430,597.37
2.本期利润	10,066,020.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.0034
4.期末基金资产净值	2,509,810,877.63
5.期末基金份额净值	0.8366

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,封闭式基金交易佣金等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

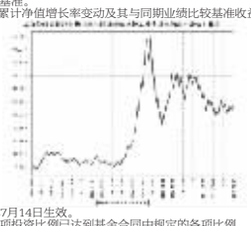
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.41%	2.00%	-	-	-	-

注:基金合同中未规定业绩比较基准。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金基金合同于1999年7月14日生效。
2、截至建仓期结束,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陈鹏	本基金基金经理	2013年1月26日	-	10	陈鹏先生,国籍中国,清华大学工商管理硕士,10年证券从业经验。曾在联合证券有限责任公司任行业研究员;2006年5月加入鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作,历任行业研究员、鹏华价值优势股票型证券投资基金(LOF)基金经理助理,2007年8月至2011年1月担任鹏华行业成长证券投资基金基金经理,2008年8月至2011年5月担任鹏华普丰基金基金经理,2011年6月至2013年3月担任鹏华新兴产业股票型证券投资基金基金经理,2011年1月起至今担任鹏华中国50开放式证券投资基金基金经理,2013年1月起兼任鹏华普丰基金基金经理,现同时担任基金管理部副总经理、投资决策委员会成员。陈鹏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 管理人对投资期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度,确保不同投资组合在研究、交易、分配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。

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次,主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年四季度,市场陷入震荡状态,不同风格指数中,沪深300指数波动幅度较小,创业板指数波动剧烈,但从季度收益角度看,创业板仍然线胜了沪深300指数。季度初期,市场热点较多,例如:军工、商业、光伏等,进入12月随着资金紧张程度加剧,市场总体开始走弱。

季度内,基于持有股票估值普遍偏低,本基金保持了较高仓位,行业配置变化不大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为0.41%,同期上证综指下跌2.70%,深证成指下跌4.61%,沪深300指数下跌3.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年,国内经济预计将延续调整的格局——在转换增长方式的大背景下,经济增速恐怕难有超预期表现;同时,虽然面对诸多挑战,但是政府托底经济的意图还在,这会导致经济呈现欲振乏力,下行有底的状态。具体的增速与节奏,比较多的取决于政策层面推进改革的力度与速度。

至于A股市场,当前震荡疲弱的状态可能还会持续一段时间。短期来看,资金成本的高企从2013下半年以来一直威胁着股债市场,金融地产等权重板块不断走低的估值是对市场流动性紧缩的一种呈现。另一方面,虽然2013年创业板牛市凝聚起来的市场人气还在,市场不时出现一些热点,但由于微观层面企业的经营状态实际乏善可陈,市场缺乏坚实有力的景气行业和优质公司支持,这种靠零散热点维系的市场热度也越来越难以为继。

在艰难的市场环境下,本基金只能谨慎操作,努力规避风险;将关注点集中于更为深入的研究公司基本面,选取优秀公司的同时,较好的控制买入成本,力争为投资人创造良好的回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,950,795,422.02	77.61
	其中:股票	1,950,795,422.02	77.61
2	固定收益投资	530,535,350.08	21.11
	其中:债券	530,535,350.08	21.11
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	18,064,252.24	0.72
6	其他资产	14,100,076.38	0.56
7	合计	2,513,495,100.72	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6,071,464.91	0.24
B	采矿业	55,096,197.29	2.20
C	制造业	297,644,632.43	11.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,250,768.60	0.85
E	建筑业	30,664,406.89	1.22
F	批发和零售业	24,755,851.49	0.99
G	交通运输、仓储和邮政业	19,887,542.65	0.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,232,422.34	0.73
J	金融业	302,668,972.79	12.06
K	房地产业	40,439,999.04	1.61
L	租赁和商务服务业	5,914,801.08	0.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,089,721.72	0.24
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	2,070,144.00	0.08
S	综合	8,413,324.69	0.34
	合计	839,200,249.92	33.44

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	552,021,770.49	21.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	57,239,682.00	2.28
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	-	-
J	金融业	285,858,235.82	11.39
K	房地产业	216,475,483.79	8.63
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	1,111,595,172.10	44.29

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	2,892,023	31,494,130.47	1.25
2	600016	民生银行	3,911,565	30,197,281.80	1.20
3	601166	兴业银行	2,805,655	28,449,341.70	1.13
4	601318	中国平安	583,998	24,370,236.54	0.97
5	000001	平安银行	1,889,622	23,147,869.50	0.92
6	600000	浦发银行	1,965,313	18,532,901.59	0.74
7	600837	海通证券	1,393,630	15,775,891.60	0.63
8	600030	中信证券	1,193,395	15,215,786.25	0.61
9	000002	万 科A	1,718,650	13,800,759.50	0.55
10	000651	格力电器	414,410	13,534,630.60	0.54

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	11,999,983	152,999,783.25	6.10
2	002250	联化科技	4,550,178	95,508,236.22	3.81
3	600383	金地集团	13,999,907	93,519,378.76	3.73
4	600519	贵州茅台	651,495	83,638,928.10	3.33
5	600585	海螺水泥	4,889,796	82,930,940.16	3.30

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	526,474,000.00	20.98
	其中:政策性金融债	526,474,000.00	20.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,061,350.08	0.16
8	其他	-	-
9	合计	530,535,350.08	21.14

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130201	13国开01	1,500,000	149,985,000.00	5.98
2	130218	13国开18	1,500,000	149,055,000.00	5.94
3	130222	13国开22	1,000,000	88,280,000.00	3.52
4	130322	13进出22	500,000	49,720,000.00	1.98
5	110310	11进出10	500,000	49,710,000.00	1.98

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金投资的指数部分中的前十名证券之一的中国平安的发行主体中国平安保险(集团)股份有限公司(简称“中国平安”)于2013年5月22日发布公告称其控股子公司平安证券收到中国证监会《行政处罚和市场禁入事先告知书》,中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在“万福生科”发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐机构资格3个月。2013年10月15日,中国平安发布公告称近日收到中国证监会《行政处罚决定书》([2013]48号),决定对平安证券予以前述行政处罚。

对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,认为中国平安作为国内最大的保险机构之一将长期受益于我国保险行业的发展,从处罚公告中知悉,2012年平安证券投行业务承销佣金收入占平安集团营业收入的0.19%,净利润的0.66%,对平安集团的财务状况及经营成果并不产生实质性影响。本次行政处罚对该股票的投资价值不产生重大影响,该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的指数部分中的前十名证券之一的海通证券的发行人海通证券股份有限公司于2013年4月22日收到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对海通证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》(沪证监决【2013】12号)(以下简称“决定”),主要内容如下:“经查,我局发现你公司发行的“一海通财”系列产品系现行监管规则未予明确的创新型产品,但你公司未按照《证券公司业务(产品)创新工作指引(试行)》的规定,向中国证监会机构监管部履行创新产品方案报送义务。”针对决定提出的问题,发行人组织整改,完善相关工作程序,并对相关责任人进行了责任追究和处分。

对该股票的投资决策程序的说明:本次监管措施对该股票的投资价值不产生重大影响。本基金为ETF基金,为更好地跟踪标的指数,控制跟踪误差对该股票的投资属于按照指数成分股的权重进行配置,符合ETF基金的管理规定,该股票的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的积极投资部分中的前五名证券之一的贵州茅台的发行主体贵州茅台酒股份有限公司之控股子公司贵州茅台酒销售有限公司因违反了《中华人民共和国反垄断法》的有关规定,于2013年2月22日收到贵州省物价局《行政处罚决定书》,被处以罚款二亿四千七百万元人民币。

对该股票的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,认为高端白酒虽然短期内面临各种压力,但贵州茅台酒因为品质卓越、品牌力强大,仍然拥有深厚的消费潜力。行政处罚不改变该股票的长期投资价值。该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	380,685.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,719,391.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,100,076.38

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	3,466,392.30	0.14
2	110017	中海转债	216,072.90	0.01
3	110022	同仁转债	134,935.20	0.01

5.10.5 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

5.10.6报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.10.7投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

6.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	3,750,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	3,750,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.13

注:本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资适用的费率标准相一致。

6.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期本申购、赎回或者买卖本基金基金份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

(一)《普丰证券投资基金基金合同》;

(二)《普丰证券投资基金托管协议》;

(三)《普丰证券投资基金2013年第4季度报告》(原文)。

7.2 存放地点

深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层鹏华基金管理有限公司。

北京市西城区复兴门内大街56号中国工商银行股份有限公司

7.3 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
2014年1月21日

鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)

【2013】第四季度报告

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华中证500指数(LOF)
基金主代码	160616
交易代码	160616
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2010年2月5日
报告期末基金份额总额	761,808,825.91份
投资目标	采用指数化投资方式,追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化,力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内,以实现对中证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或成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。
业绩比较基准	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。
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

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”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)
1.本期已实现收益	24,257,899.26
2.本期利润	-5,899,345.82
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0072
4.期末基金资产净值	608,278,578.56
5.期末基金份额净值	0.798

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

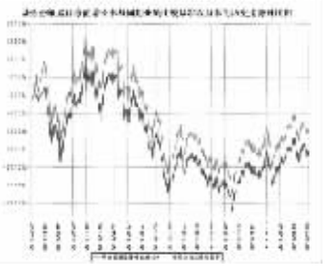
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.12%	1.33%	-1.04%	1.33%	-0.08%	0.00%

注:业绩比较基准=中证500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金基金合同于2010年2月5日生效。
2、截至建仓期结束,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
杨靖	本基金基金经理	2013年3月30日	-	13	杨靖先生,国籍中国,管理学硕士,13年证券从业经验。曾在长城证券公司从事证券研究工作,先后任研究员、行业研究小组组长;2001年6月加盟鹏华基金管理有限公司从事行业研究工作,2005年开始先后任鹏华中国50开放式证券投资基金、鹏华行业成长证券投资基金基金经理助理,2006年8月至2007年4月担任原鹏华普润基金(2007年4月已转型为鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF))基金经理,2007年4月至2009年10月担任鹏华优质治理股票型证券投资基金(LOF)基金经理,2009年4月起担任鹏华沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理,2012年9月起兼任鹏华中证A股资源产业指数分级证券投资基金基金经理,2013年3月起兼任鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)基金经理。杨靖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,增聘王咏辉担任本基金基金经理。
王咏辉	本基金基金经理	2013年12月27日	-	15	王咏辉先生,英国牛津大学工程和计算机专业硕士,15年证券基金从业经验。曾担任伦敦摩根大通(JP Morgan)投资基金管理公司分析员、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(Barclays Capital)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等职,2010年4月至2012年8月担任泰达宏利中证财富大盘指数型证券投资基金基金经理,2011年7月至2012年8月担任泰达宏利全球新格局证券投资QDII基金基金经理,2011年12月至2012年8月担任泰达宏利中证500指数分级证券投资基金基金经理;2012年11月加盟鹏华基金管理有限公司,现任量化投资部总经理、投资决策委员会成员,2013年12月起担任鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)基金经理。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,增聘王咏辉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 管理人对投资期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度,确保不同投资组合在研究、交易、分配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。

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为1次,主要原因在于指数成分股交易不活跃导致。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

中证500指数3季度呈现震荡走势。四季度虽然有十八届三中全会胜利召开的激励,但是年末资金偏紧、IPO重启的预期都制约了市场上行的空间。

经过精心操作,本基金的跟踪误差控制在较低的水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.798元;本报告期基金份额净值增长率为-1.12%,同期中证500指数为-1.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

党的十八届三中全会胜利召开,展示了管理层坚定改革的决心和必胜信心。但转换经济增长方式固然伴随着改革阵痛,也会有改革红利。未来中国经济发展必然更加倚重机制创新、技术创新,政府资源、市场资源也会更多地偏向新兴产业和机制灵活市场化程度高的中小型企业。但IPO的重启也会增加市场的供给,因此投资者需要关注可能由此带来的阶段性调整风险。

中证500指数相对其他主流指数因其中小市值个股占比较大,对转型经济中的新兴产业代表性更强,投资者可考虑逢低买入。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	577,821,387.58	94.33
	其中:股票	577,821,387.58	94.33
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	32,455,154.67	5.30
6	其他资产	2,254,187.65	0.37
7	合计	612,530,729.90	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	8,706,692.18	1.43
B	采矿业	13,157,599.66	2.16
C	制造业	338,732,292.63	55.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,966,725.63	3.12
E	建筑业	15,063,606.13	2.48
F	批发和零售业	39,937,766.29	6.57
G	交通运输、仓储和邮政业	17,347,856.25	2.85
H	住宿和餐饮业	1,388,172.10	0.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,175,837.47	4.80
J	金融业	5,796,881.03	0.95
K	房地产业	53,645,893.20	8.82
L	租赁和商务服务业	11,510,961.53	1.89
M	科学研究和技术服务业	2,829,340.56	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	5,754,104.06	0.95
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	10,734,669.74	1.76
S	综合	5,072,989.12	0.83
	合计	577,821,387.58	94.99

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600388	龙净环保	96,988	3,251,037.76	0.53
2	002152	广电运通	162,619	3,120,658.61	0.51
3	002063	远光软件	157,984	3,072,788.80	0.51
4	600635	大众公用	560,015	3,068,882.20	0.50
5	600499	科达机电	151,262	3,038,853.58	0.50
6	000028	国药一致	64,585	2,990,285.50	0.49
7	600200	江苏吴中	259,572	2,956,525.08	0.49
8	002410	广联达	93,056	2,931,264.00	0.48
9	600570	恒生电子	140,313	2,926,929.18	0.48
10	002250	联化科技	138,128	2,899,306.72	0.48

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

本基金投资的前十名证券之一的杨瑞股份的发行人烟台杰瑞石油服务集团股份有限公司于2013年4月8日收到深圳证券交易所下发的《关于对烟台杰瑞石油服务集团股份有限公司的监管函》(中小板监管函[2013]第38号,以下简称“《监管函》”)。《监管函》指出:公司于2013年3月23日的《关于2012年度日常关联交易及2013年度预计额度的公告》中披露2012年与合营公司德美动力发生的采购金额为14,696.87万元,超出公司于2012年3月17日披露的与德美动力之间日常关联交易预计金额范围上限(10,000万元),超出部分占公司最近一期经审计净资产的1.49%。针对监管函提出的问题,杰瑞股份进行处理,并完善日常监管流程。

对该股票的投资决策程序的说明:本次监管措施对该股票的投资价值不产生重大影响。本基金为指数基金,为更好地跟踪标的指数,控制跟踪误差对该股票的投资属于按照指数成分股的权重进行配置,符合指数基金的管理规定,该股票的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的其他前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.10.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	226,993.72
2	应收证券清算款	1,919,946.80
3	应收股利	-
4	应收利息	6,525.15
5	应收申购款	100,721.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,254,187.65

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指