

## 鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)

## [2015] 年 度 报 告 摘 要

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：2016年3月30日

## 1.1 重要提示

基金管理人的承诺及保证：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、完整性负完全法律责任。本基金年度报告已经三分之二以上独立董事签字确认，并由董事长签发。

基金管理人和托管人声明：根据有关法律法规的规定，基金管理人和基金托管人规定，于2016年3月26日复核了本年度报告，对年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策、利润分配政策、报告期内基金的交易情况、投资组合报告、托管协议和基金合同的内容，保证复核意见不存在虚假记载、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，投资者据此作出投资决策应仔细阅读本基金的基本情况和招募说明书及其更新。

本公司所管理的基金已披露年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

基金管理人和基金经理对本基金“特殊风险提示”：本基金对会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告，自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

## 1.2 基金简介

基金名称 鹏华中证500指数(LOF)

场内简称 鹏华500

基金代码 360016

交易代码 360016

基金类别 上市开放式基金(LOF)

基金合同生效日 2010年2月16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

报告期末基金资产净值 259,019,409.61元

基金份额净值 1.000 元

报告期末基金份额总额 259,019,409.61份

报告期损益 2010-01-01至2015-12-31

注：本基金在交易所行情系统净值行情栏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 实现长期资本增值，追求基金净值增长率与沪深300指数收益率之间的差额最大化，力图在控制风险的前提下获得超越基准的收益。

投资策略 本基金主要通过股票投资达到投资目标。股票投资的策略是：在综合分析宏观经济形势、行业景气度、公司基本面的基础上，精选具有核心竞争力的上市公司，构建股票投资组合，力争实现基金净值的持续增长。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×65%+银行定期存款利率(税后)×35%

风险收益特征 本基金为股票型基金，风险收益特征较高，适合风险承受能力较强的投资者。

上市地点 上海证券交易所

基金管理人和基金托管人 中国工商银行股份有限公司

基金销售机构 中国工商银行股份有限公司

基金募集期 2010-01-01至2010-02-16

基金封闭期 2010-02-17至2010-03-16

基金开放期 2010-03-17至2010-04-15

基金存续期 2010-04-16至2015-12-31

基金类型 上市开放式基金(LOF)

基金规模 360,000,000份

基金合同生效日 2010-02-16

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

基金类别 上市开放式基金(LOF)

基金代码 360016

交易代码 360016

上市地点 上海证券交易所

基金管理人和基金托管人 中国工商银行股份有限公司

基金销售机构 中国工商银行股份有限公司

基金募集期 2010-01-01至2010-02-16

基金封闭期 2010-02-17至2010-03-16

基金开放期 2010-03-17至2010-04-15

基金存续期 2010-04-16至2015-12-31

基金类型 上市开放式基金(LOF)

基金规模 360,000,000份

基金合同生效日 2010-02-16

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

基金类别 上市开放式基金(LOF)

基金代码 360016

交易代码 360016

上市地点 上海证券交易所

基金管理人和基金托管人 中国工商银行股份有限公司

基金销售机构 中国工商银行股份有限公司

基金募集期 2010-01-01至2010-02-16

基金封闭期 2010-02-17至2010-03-16

基金开放期 2010-03-17至2010-04-15

基金存续期 2010-04-16至2015-12-31

基金类型 上市开放式基金(LOF)

基金规模 360,000,000份

基金合同生效日 2010-02-16

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

基金类别 上市开放式基金(LOF)

基金代码 360016

交易代码 360016

上市地点 上海证券交易所

基金管理人和基金托管人 中国工商银行股份有限公司

基金销售机构 中国工商银行股份有限公司

基金募集期 2010-01-01至2010-02-16

基金封闭期 2010-02-17至2010-03-16

基金开放期 2010-03-17至2010-04-15

基金存续期 2010-04-16至2015-12-31

基金类型 上市开放式基金(LOF)

基金规模 360,000,000份

基金合同生效日 2010-02-16

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

基金类别 上市开放式基金(LOF)

基金代码 360016

交易代码 360016

上市地点 上海证券交易所

基金管理人和基金托管人 中国工商银行股份有限公司

基金销售机构 中国工商银行股份有限公司

基金募集期 2010-01-01至2010-02-16

基金封闭期 2010-02-17至2010-03-16

基金开放期 2010-03-17至2010-04-15

基金存续期 2010-04-16至2015-12-31

基金类型 上市开放式基金(LOF)

基金规模 360,000,000份

基金合同生效日 2010-02-16

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

基金类别 上市开放式基金(LOF)

基金代码 360016

交易代码 360016

上市地点 上海证券交易所

基金管理人和基金托管人 中国工商银行股份有限公司

基金销售机构 中国工商银行股份有限公司

基金募集期 2010-01-01至2010-02-16

基金封闭期 2010-02-17至2010-03-16

基金开放期 2010-03-17至2010-04-15

基金存续期 2010-04-16至2015-12-31

基金类型 上市开放式基金(LOF)

基金规模 360,000,000份

基金合同生效日 2010-02-16

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

基金类别 上市开放式基金(LOF)

基金代码 360016

交易代码 360016

上市地点 上海证券交易所

基金管理人和基金托管人 中国工商银行股份有限公司

基金销售机构 中国工商银行股份有限公司

基金募集期 2010-01-01至2010-02-16

基金封闭期 2010-02-17至2010-03-16

基金开放期 2010-03-17至2010-04-15

基金存续期 2010-04-16至2015-12-31

基金类型 上市开放式基金(LOF)

基金规模 360,000,000份

基金合同生效日 2010-02-16

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

基金类别 上市开放式基金(LOF)

基金代码 360016

交易代码 360016

上市地点 上海证券交易所

基金管理人和基金托管人 中国工商银行股份有限公司

基金销售机构 中国工商银行股份有限公司

基金募集期 2010-01-01至2010-02-16

基金封闭期 2010-02-17至2010-03-16

基金开放期 2010-03-17至2010-04-15

基金存续期 2010-04-16至2015-12-31

基金类型 上市开放式基金(LOF)

基金规模 360,000,000份

基金合同生效日 2010-02-16

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

基金类别 上市开放式基金(LOF)

基金代码 360016

交易代码 360016

上市地点 上海证券交易所

基金管理人和基金托管人 中国工商银行股份有限公司

基金销售机构 中国工商银行股份有限公司

基金募集期 2010-01-01至2010-