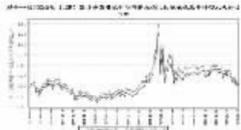


鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

变动的比较



注:1.本基金基金合同于2018年02月06日生效,2.截至建仓期末,本基金的各项投资比例已符合基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标 注:无。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: Name, Title, Tenure, and Bio. Lists the fund manager and their background.

4.2 管理人对报告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,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,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投资策略的情形,本基金运作符合基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明 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,本基金未发生法律法规及交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析 本基金秉承追求基金的投资回报,在应对基金申购赎回的基础上,力争跟踪指数的收益,并严格控制跟踪误差控制在合理范围内。

4.5 报告期内基金的投资表现 截至本报告期末本基金份额净值为1.062元;本报告基金份额净值增长率为-7.23%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值变动说明 无。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing portfolio composition by asset class: Equity, Fixed Income, Cash, etc.

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table showing industry breakdown of domestic equity investments.

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前十名股票投资明细

Table listing top 10 stock holdings by market value.

5.4 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债券投资明细

Table listing top 5 bond holdings by market value.

5.5 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

5.6 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权证投资明细

5.7 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

5.8 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

5.9 报告期末本基金投资的期权投资情况说明

5.10 报告期末本基金投资的资产支持证券投资明细

5.11 报告期末本基金投资的国债逆回购投资明细

5.12 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

5.13 报告期末本基金持有的流通受限证券

6 开放式基金份额变动

6.1 基金份额变动

Table showing changes in fund assets and liabilities.

6.2 基金申购赎回情况

Table showing subscription and redemption data.

6.3 基金转换情况

Table showing fund conversion data.

6.4 基金分红情况

Table showing dividend distribution data.

6.5 基金费用

Table showing fund expenses.

6.6 基金业绩

Table showing fund performance metrics.

6.7 基金持有人户数

6.8 基金资产净值

6.9 基金净值增长率

6.10 基金持有人户数

6.11 基金资产净值

6.12 基金净值增长率

6.13 基金持有人户数

6.14 基金资产净值

6.15 基金净值增长率

6.16 基金持有人户数

6.17 基金资产净值

6.18 基金净值增长率

6.19 基金持有人户数

6.20 基金资产净值

6.21 基金净值增长率

6.22 基金持有人户数

6.23 基金资产净值

6.24 基金净值增长率

6.25 基金持有人户数

6.26 基金资产净值

6.27 基金净值增长率

6.28 基金持有人户数

6.29 基金资产净值

6.30 基金净值增长率

6.31 基金持有人户数

6.32 基金资产净值

6.33 基金净值增长率

6.34 基金持有人户数

6.35 基金资产净值

6.36 基金净值增长率

6.37 基金持有人户数

6.38 基金资产净值

6.39 基金净值增长率

6.40 基金持有人户数

6.41 基金资产净值

6.42 基金净值增长率

6.43 基金持有人户数

6.44 基金资产净值

6.45 基金净值增长率

6.46 基金持有人户数

6.47 基金资产净值

6.48 基金净值增长率

6.49 基金持有人户数

6.50 基金资产净值

6.51 基金净值增长率

6.52 基金持有人户数

6.53 基金资产净值

6.54 基金净值增长率

6.55 基金持有人户数

6.56 基金资产净值

6.57 基金净值增长率

6.58 基金持有人户数

6.59 基金资产净值

6.60 基金净值增长率

6.61 基金持有人户数

6.62 基金资产净值

6.63 基金净值增长率

6.64 基金持有人户数

6.65 基金资产净值

6.66 基金净值增长率

6.67 基金持有人户数

6.68 基金资产净值

6.69 基金净值增长率

6.70 基金持有人户数

6.71 基金资产净值

6.72 基金净值增长率

6.73 基金持有人户数

6.74 基金资产净值

6.75 基金净值增长率

6.76 基金持有人户数

6.77 基金资产净值

6.78 基金净值增长率

鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

变动的比较



注:1.本基金基金合同于2018年02月06日生效,2.截至建仓期末,本基金的各项投资比例已符合基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标 注:无。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: Name, Title, Tenure, and Bio. Lists the fund manager and their background.

4.2 管理人对报告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,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,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投资策略的情形,本基金运作符合基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明 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,本基金未发生法律法规及交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析 本基金秉承追求基金的投资回报,在应对基金申购赎回的基础上,力争跟踪指数的收益,并严格控制跟踪误差控制在合理范围内。

4.5 报告期内基金的投资表现 截至本报告期末本基金份额净值为1.065元;本报告基金份额净值增长率为-5.93%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值变动说明 无。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing portfolio composition by asset class: Equity, Fixed Income, Cash, etc.

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table showing industry breakdown of domestic equity investments.

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前十名股票投资明细

Table listing top 10 stock holdings by market value.

5.4 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债券投资明细

Table listing top 5 bond holdings by market value.

5.5 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

5.6 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权证投资明细

5.7 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

5.8 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

5.9 报告期末本基金投资的期权投资情况说明

5.10 报告期末本基金投资的资产支持证券投资明细

5.11 报告期末本基金投资的国债逆回购投资明细

5.12 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

5.13 报告期末本基金持有的流通受限证券

6 开放式基金份额变动

6.1 基金份额变动

Table showing changes in fund assets and liabilities.

6.2 基金申购赎回情况

Table showing subscription and redemption data.

6.3 基金转换情况

Table showing fund conversion data.

6.4 基金分红情况

Table showing dividend distribution data.

6.5 基金费用

Table showing fund expenses.

6.6 基金业绩

Table showing fund performance metrics.

6.7 基金持有人户数

6.8 基金资产净值

6.9 基金净值增长率

6.10 基金持有人户数

6.11 基金资产净值

6.12 基金净值增长率

6.13 基金持有人户数

6.14 基金资产净值

6.15 基金净值增长率

6.16 基金持有人户数

6.17 基金资产净值

6.18 基金净值增长率

6.19 基金持有人户数

6.20 基金资产净值

6.21 基金净值增长率

6.22 基金持有人户数

6.23 基金资产净值

6.24 基金净值增长率

6.25 基金持有人户数

6.26 基金资产净值

6.27 基金净值增长率

6.28 基金持有人户数

6.29 基金资产净值

6.30 基金净值增长率

6.31 基金持有人户数

6.32 基金资产净值

6.33 基金净值增长率

6.34 基金持有人户数

6.35 基金资产净值

6.36 基金净值增长率

6.37 基金持有人户数

6.38 基金资产净值

6.39 基金净值增长率

6.40 基金持有人户数

6.41 基金资产净值

6.42 基金净值增长率

6.43 基金持有人户数

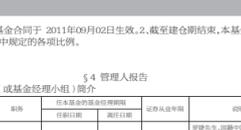
6.44 基金资产净值

6.45 基金净值增长率

鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

变动的比较



注:1.本基金基金合同于2018年02月06日生效,2.截至建仓期末,本基金的各项投资比例已符合基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标 注:无。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: Name, Title, Tenure, and Bio. Lists the fund manager and their background.

4.2 管理人对报告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,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,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投资策略的情形,本基金运作符合基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明 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,本基金未发生法律法规及交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析 本基金秉承追求基金的投资回报,在应对基金申购赎回的基础上,力争跟踪指数的收益,并严格控制跟踪误差控制在合理范围内。

4.5 报告期内基金的投资表现 截至本报告期末本基金份额净值为1.065元;本报告基金份额净值增长率为-5.93%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值变动说明 无。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing portfolio composition by asset class: Equity, Fixed Income, Cash, etc.

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table showing industry breakdown of domestic equity investments.

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前十名股票投资明细

Table listing top 10 stock holdings by market value.

5.4 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债券投资明细

Table listing top 5 bond holdings by market value.

5.5 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

5.6 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权证投资明细

5.7 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明

5.8 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

5.9 报告期末本基金投资的期权投资情况说明

5.10 报告期末本基金投资的资产支持证券投资明细

5.11 报告期末本基金投资的国债逆回购投资明细

5.12 报告期末本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

5.13 报告期末本基金持有的流通受限证券

6 开放式基金份额变动

6.1 基金份额变动

Table showing changes in fund assets and liabilities.

6.2 基金申购赎回情况

Table showing subscription and redemption data.

6.3 基金转换情况

Table showing fund conversion data.

6.4 基金分红情况

Table showing dividend distribution data.

6.5 基金费用

Table showing fund expenses.

6.6 基金业绩

Table showing fund performance metrics.

6.7 基金持有人户数

6.8 基金资产净值

6.9 基金净值增长率

6.10 基金持有人户数

6.11 基金资产净值

6.12 基金净值增长率

6.13 基金持有人户数

6.14 基金资产净值

6.15 基金净值增长率

鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

变动的比较



注:1.本基金基金合同于2018年02月06日生效,2.截至建仓期末,本基金的各项投资比例已符合基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标 注:无。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: Name, Title, Tenure, and Bio. Lists the fund manager and their background.

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明