

鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)

[2010] 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

报告书出日期:2011年1月22日

基金合同生效日:2010年2月5日

报告期末基金份额总额:1,209,388,824份

基金投资目标: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之间的最小化差额,力争将平均跟踪误差控制在5%以内,以实现对中证500指数的有效跟踪。

基金投资策略: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指数中的基本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定期调整。当预期成份股发生调整时,根据成份股的增减、增发、分红等行为,或因成份股公司经营状况、股权结构等发生较大变化,或因成份股停牌、被摘牌、退市等导致成份股无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人有权对投资组合管理进行适当变更和调整,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:本基金属于股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、混合型基金,为证券投资基金中的高预期风险、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

§ 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

基金合同生效日:2010年2月5日

报告期末基金份额总额:1,209,388,824份

基金投资目标: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之间的最小化差额,力争将平均跟踪误差控制在5%以内,以实现对中证500指数的有效跟踪。

基金投资策略: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指数中的基本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定期调整。当预期成份股发生调整时,根据成份股的增减、增发、分红等行为,或因成份股公司经营状况、股权结构等发生较大变化,或因成份股停牌、被摘牌、退市等导致成份股无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人有权对投资组合管理进行适当变更和调整,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:本基金属于股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、混合型基金,为证券投资基金中的高预期风险、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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2010年10月1日~2010年12月31日)

1.本期已实现收益 105,052,079.56

2.本期利润 139,727,830.64

3.加权平均基金份额本期利润 0.0942

4.期末基金份额净值 1,240,974,485.72

5.期末基金份额净值 1.029

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 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

基金业绩报酬计提比例与同行业指数回报和基准收益的差别

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 准收益标准差④ ①-③ ②-④

过去一个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%

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%

3.2.1 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

基金业绩报酬计提比例与同行业指数回报和基准收益的差别

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 准收益标准差④ ①-③ ②-④

过去一个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%

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

基金业绩报酬计提比例与同行业指数回报和基准收益的差别

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 准收益标准差④ ①-③ ②-④

过去一个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%

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%

3.2.3 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

基金业绩报酬计提比例与同行业指数回报和基准收益的差别

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 准收益标准差④ ①-③ ②-④

过去一个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%

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%

3.2.4 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

基金业绩报酬计提比例与同行业指数回报和基准收益的差别

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 准收益标准差④ ①-③ ②-④

过去一个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%

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%

3.2.5 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

基金业绩报酬计提比例与同行业指数回报和基准收益的差别

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 准收益标准差④ ①-③ ②-④

过去一个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%

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%

3.2.6 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

基金业绩报酬计提比例与同行业指数回报和基准收益的差别

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 准收益标准差④ ①-③ ②-④

过去一个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%

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%

3.2.7 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

基金业绩报酬计提比例与同行业指数回报和基准收益的差别

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 准收益标准差④ ①-③ ②-④

过去一个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%

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%

3.2.8 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

基金业绩报酬计提比例与同行业指数回报和基准收益的差别

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 准收益标准差④ ①-③ ②-④

过去一个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%

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%

3.2.9 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

基金业绩报酬计提比例与同行业指数回报和基准收益的差别

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 准收益标准差④ ①-③ ②-④

过去一个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%

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%

3.2.10 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

基金业绩报酬计提比例与同行业指数回报和基准收益的差别

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 准收益标准差④ ①-③ ②-④

过去一个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%

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%

3.2.11 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

基金业绩报酬计提比例与同行业指数回报和基准收益的差别

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 准收益标准差④ ①-③ ②-④

过去一个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%

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%

3.2.12 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

基金业绩报酬计提比例与同行业指数回报和基准收益的差别

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 准收益标准差④ ①-③ ②-④

过去一个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%

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%

3.2.13 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

基金业绩报酬计提比例与同行业指数回报和基准收益的差别

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 准收益标准差④ ①-③ ②-④

过去一个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%

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%

3.2.14 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

基金业绩报酬计提比例与同行业指数回报和基准收益的差别

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 准收益标准差④ ①-③ ②-④

过去一个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%

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%

3.2.15 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

基金业绩报酬计提比例与同行业指数回报和基准收益的差别

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 准收益标准差④ ①-③ ②-④

过去一个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%

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%

3.2.16 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

基金业绩报酬计提比例与同行业指数回报和基准收益的差别

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 准收益标准差④ ①-③ ②-④

过去一个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%

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%

3.2.17 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

基金业绩报酬计提比例与同行业指数回报和基准收益的差别

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 准收益标准差④ ①-③ ②-④

过去一个月 5.43% 1.83% 5.69% 1.84% -0.26% -0.01%

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%

3.2.18 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

基金业绩报酬计提比例与同行业指数回报和基准收益的差别

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 准收益标准差④ ①-③ ②-④