

## 鹏华中证500指数证券投资基金 LOF)

## [2012] 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

报告告出日期:2013年1月22日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员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基金合同规定，于2013年1月17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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2012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)
基金代码	160616
交易代码	160616
基金运作方式	上证交易所上市开放式(LOF)
基金合同生效日	2010-07-24/2010-07-25
报告期末基金份额总额	1,021,228,399.509
投资目标	本基金采取量化投资方法，在层面上追求该类基金与行业比较基准收益之间的跟踪误差最小化，力争在扣除交易成本后的35%以内，年度跟踪误差控制在4%以内，以实现对中证500指数的有效复制。
投资策略	本基金采用量化投资方法，通过分析中证500指数中的基差权重和建模指数化投资策略，并据此指导投资组合及其具体的量化选股模型。
投资策略	当股票价格发生调整和份额发生变动、增发、分派等变化时，或因基金的申购赎回、回购等基本原因导致持有的股票的市场价格带来影响，或因某些特殊情况下导致流动不畅时，或其调整和评估方法出现偏差时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当调整和优化，力求紧跟跟踪误差。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于采用量化方法的股票基金，其预期的风险收益水平高于货币市场基金、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(2012年10月1日 - 2012年12月31日)
1.本期已实现收益	-80,806,561.59
2.本期利润	17,544,971.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0134
4.期末基金份额净值	822,238,684.41
5.期末基金份额净值	0.685

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.所述基金绩效指标包括持有人认购或申购基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等。

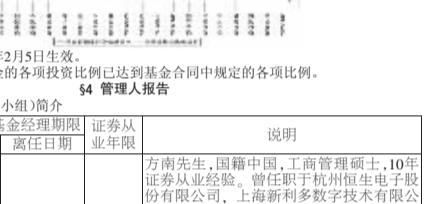
3.2 基金净值表现

3.2.1 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)	基准收益率标准差(④)
过去三个月	1.78%	1.38%	2.30%	1.37%

注:业绩比较基准=中证500指数收益率×95%+银行存款利率×5%。

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



注:1.本基金合同于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(基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
方南	本基金基金经理	2010年2月5日	10	方南先生，国籍中国，工商管理硕士，10年证券从业经验。曾任职于杭州恒生电子股份有限公司、海通创新多利数字技术有限公司。2001年11月加盟鹏华基金管理有限公司，历任金融工程师、部门研究员、金融工程师(原)助理经理、助理经理、鹏华中证500指数基金(LOF)基金经理助理。2010年2月至今担任鹏华中证500指数基金(LOF)基金经理助理。2010年8月至今担任鹏华上证民富SOIET基金及其联接基金基金经理。2011年9月起担任华深华证深证ETF基金及其联接基金基金经理。方南先生具备基金从业资格。本报吿期内本基金基金经理未发生变更。

注:1.任用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,任职日期即为基金合同生效日。

2.从业的义无反顾从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵守廉洁情况的说明

报告期内，本基金代理人严格遵守《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取最大利益。

4.3 公平交易专项说明

报告期内，本基金代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，本基金发生过逆向操作且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报吿期内基金管理人管人严格按照《证券投资基金法》等法律法规的规定，对日常交易行为进行了重点监控，未发现存在不公平交易和利益输送的情况。

4.4 报告期内基金的报擦策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金的报擦策略和报擦运作分析

第四季度的市场走势跌势“独领风骚”的意味，高位换手率累积的超额收益效应减弱，情绪的逐步积累支撑了12月份的反弹。整个季度的波动到达年内的一个峰值。对基金经理的管理带来一定影响，面临这种情况，我们进行了精心的管理，较好地实现了报擦差额控制目标。

4.4.2 报告期内基金的基本面报擦

报告期内，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

4.5 公平交易专项说明

报告期内，本基金未发生过逆向操作且对基金财产造成损失的异常交易行为。

对于基金经理而言，主要来源有两方面：一是本期基金经理定了一项中期的报擦差额，使得单周的报擦差额较大，对我们跟据管理带来了一定影响。二是目前的报擦差额是7.7%，而本期跟据差额是5.6%，两者相差0.1%，对于我们跟据管理带来了一定影响。

4.5.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金代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。

4.5.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金未发生过逆向操作且对基金财产造成损失的异常交易行为。

由于“四舍五入”的原因，投资组合报告中分子分母之和与合计项之间可能存在尾差。

4.6 开放式基金的报擦策略和报擦运作分析

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

4.7 报告期内持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

4.8 报告期内持有的处于转股期的可转换债券情况说明

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

4.8.1 报告期内持有的处于转股期的可转换债券

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

4.8.2 其他资产构成

本基金报告期末未持有其他资产。

4.8.3 其他资产构成

本基金报告期末未持有其他资产。

4.9 合计

2,584,115,292.73

0.8614

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.所述基金绩效指标包括持有人认购或申购基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等。

3.1 主要财务指标

3.1.1 主要财务指标

3.1.2 报告期中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)	基准收益率标准差(④)
过去三个月	7.06%	2.30%	-	-

注:1.本基金合同中约定业绩比较基准。

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

上缴10.02%。

4.5 管理费组合

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

5.1.2 报告期中基金资产组合情况

5.1.3 报告期中基金资产组合情况

5.1.4 报告期中基金资产组合情况

5.1.5 报告期中基金资产组合情况

5.1.6 报告期中基金资产组合情况

5.1.7 报告期中基金资产组合情况

5.1.8 报告期中基金资产组合情况

5.1.9 报告期中基金资产组合情况

5.1.10 报告期中基金资产组合情况

5.1.11 报告期中基金资产组合情况

5.1.12 报告期中基金资产组合情况

5.1.13 报告期中基金资产组合情况

5.1.14 报告期中基金资产组合情况

5.1.15 报告期中基金资产组合情况

5.1.16 报告期中基金资产组合情况

5.1.17 报告期中基金资产组合情况

5.1.18 报告期中基金资产组合情况

5.1.19 报告期中基金资产组合情况

5.1.20 报告期中基金资产组合情况

5.1.21 报告期中基金资产组合情况

5.1.22 报告期中基金资产组合情况

5.1.23 报告期中基金资产组合情况

5.1.24 报告期中基金资产组合情况

5.1.25 报告期中基金资产组合情况

5.1.26 报告期中基金资产组合情况

5.1.27 报告期中基金资产组合情况

5.1.28 报告期中基金资产组合情况

5.1.29 报告期中基金资产组合情况

5.1.30 报告期中基金资产组合情况

5.1.31 报告期中基金资产组合情况

5.1.32 报告期中基金资产组合情况