

鹏华中证500指数证券投资基金 (LOF)

2014 第三季度报告

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10月24日

3.1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金销售机构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10月21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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者有风险，投资需谨慎。投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。
本报告自2014年7月1日起至9月30日止。

基金简称	鹏华中证500指数(LOF)
场内简称	鹏500
基金主代码	160626
交易代码	160626
基金运作方式	契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2009年3月16日
报告期末基金份额总额	751,416,303.79份
投资策略	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，年化跟踪误差控制在4%以内，以实现对于中证500指数的有效跟踪。
投资目标	本基金采用被动式指数化投资方法，跟踪上证成份股在中证500指数中的基准权重和构建指数化投资组合，并根据标的指数成份及其权重的变化进行相应调整。
投资策略	当期成份股发生调整或成份权重发生调整，组合行业权重、行业成分权重、行业权重等无法有效复制和跟踪的指数时，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、混合基金，为证券投资基金中较高风险的品种。
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

3.1 主要财务指标	单位：人民币元
主要财务指标	报告期(2014年7月1日至2014年9月30日)
1.本期已实现收益	46,616,859.04
2.本期利润	140,555,201.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.1994
4.期末基金份额净值	753,070,665.25
5.期末基金份额净值	1.003

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)扣除相关费用后的净额，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.上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)，计入费用后实际的基金收益可能会低于所列数值。
3.2 基金净值表现

注:业绩比较基准=中证500 指数收益率 $\times 95\%$ +银行同业存款利率 $\times 5\%$

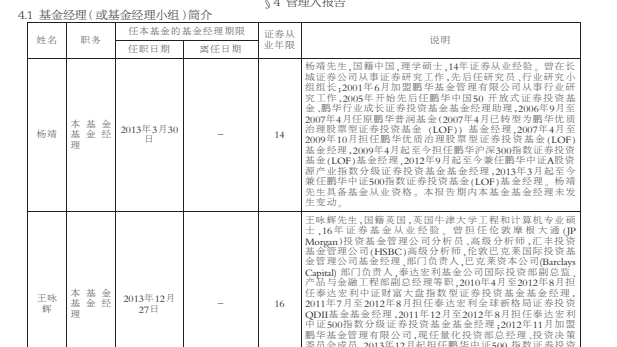
3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

本基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较见图例:

日期	基金累计净值增长率	业绩比较基准收益率
2015-3-1	1.00%	1.00%
2015-4-1	1.50%	1.50%
2015-5-1	2.00%	2.00%
2015-6-1	3.00%	3.00%
2015-7-1	4.00%	4.00%
2015-8-1	5.00%	5.00%
2015-9-1	6.00%	6.00%
2015-10-1	7.00%	7.00%
2015-11-1	8.00%	8.00%
2015-12-1	9.00%	9.00%
2016-1-1	10.00%	10.00%
2016-2-1	11.00%	11.00%
2016-3-1	12.00%	12.00%

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2014年10月21日生效。
2.截至基金合同生效日，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。

3.2.3 基金净值表现

12)	证券申购的合法持有人为申购人认购基金份额的预先规定。
13)	管理人根据本基金有关基金运作管理情况的说明。
14)	管理人、托管人根据《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定及基金合同的约定,对本基金的投资、基金管理人和托管人履行基金合同的情况,为基金份额持有人出具基金资产净值报告,并定期在基金网站内、基金销售网点、中国证监会指定网站及中国证监会要求披露的基金管理人、托管人按照基金合同的约定及时进行了公开,不存在任何虚假记载和误导性陈述并对持有人有利的事实。
15)	基金合同生效说明。
16)	公平交易策略的执行情况。
17)	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、分配各环节得到公平对待。
18)	报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。
19)	报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规的有关规定,不存在损害基金份额持有人的利益或造成不公平的申购和赎回交易或造成不公平的申购或赎回交易或造成