

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

§ 1 重要提示

基金管理人的声明:基金管理人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,并对其中内容的真实性、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的约定,于2014年10月21日核对了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人应当在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

本公司就财务资料进行审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)

场内简称:鹏华500

基金主代码:160616

交易代码:160616

基金份额发售方式:上市交易型开放式(LOF)

基金合同生效日:2010年2月5日

报告期末基金份额总额:751,416,306.70份

投资项目目标:利用量化分析方法,追求各风格增长率为互斥相对收益最大化的原则,通过定期调整资产配置比例,在长期投资中获取收益。

本基金采用量化分析方法投资于股票,根据所投资股票在中证500指数中的基本面权重构建指数化投资组合,并根据市场变化适时调整股票配置比例,力求获得超越基准收益,同时降低风险。

本基金的过往业绩并不代表未来表现。投资有风险,投资人应当在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

本公司就财务资料进行审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

报告期(2014年7月1日 - 2014年9月30日)

1.本期利润:46,616,859.04

2.本期利润:140,555,201.59

3.本期利润/基金份额本期利润:0.1994

4.期末基金资产净值:753,970,665.25

5.期末基金份额净值:1.003

注:1.本基金已实现收益指基金本期已收入,按摊余成本计算,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已确认的管理费收入;

2.本基金利润总额不包括持有人认购交易本基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费,基金转换费等),计算后用于支付应收利息低于零的差额。

3.2.2 基金净值表现

3.2.1 本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 收益率差值④ ①-③ ②-④

过去三个月 24.75% 0.94% 23.88% 0.91% 0.87% -0.03%

注:本基金业绩基准=中证500指数收益率×95%+银行存款利率×5%

3.2.2 基金份额首次以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

3.2.3 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

3.2.4 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

3.2.5 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

3.2.6 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

3.2.7 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

3.2.8 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

3.2.9 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

3.2.10 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

3.2.11 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

3.2.12 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

3.2.13 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

3.2.14 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

3.2.15 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

3.2.16 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

3.2.17 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

3.2.18 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

3.2.19 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

3.2.20 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

3.2.21 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

3.2.22 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

3.2.23 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

3.2.24 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

3.2.25 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

3.2.26 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

3.2.27 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

3.2.28 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

3.2.29 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

3.2.30 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

3.2.31 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

3.2.32 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

3.2.33 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

3.2.34 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

3.2.35 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

3.2.36 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

3.2.37 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

3.2.38 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

3.2.39 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

3.2.40 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

3.2.41 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

3.2.42 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

3.2.43 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

3.2.44 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

3.2.45 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

3.2.46 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

3.2.47 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

3.2.48 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

3.2.49 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

3.2.50 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

3.2.51 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

3.2.52 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

3.2.53 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

3.2.54 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

3.2.55 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

3.2.56 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

3.2.57 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

3.2.58 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

3.2.59 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

3.2.60 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

3.2.61 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

3.2.62 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

3.2.63 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

3.2.64 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

3.2.65 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

3.2.66 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

3.2.67 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

3.2.68 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

3.2.69 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

3.2.70 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

3.2.71 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

3.2.72 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

3.2.73 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

3.2.74 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

3.2.75 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

3.2.76 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

3.2.77 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

3.2.78 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

3.2.79 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

3.2.80 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

3.2.81 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

3.2.82 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

3.2.83 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

3.2.84 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

3.2.85 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

3.2.86 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

3.2.87 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

3.2.88 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

3.2.89 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

3.2.90 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

3.2.91 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

3.2.92 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

3.2.93 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

3.2.94 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

3.2.95 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

3.2.96 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

3.2.97 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

3.2.98 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

3.2.99 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

3.2.100 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

3.2.101 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

3.2.102 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

3.2.103 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

3.2.104 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率