

上接B06版

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40—42楼
法定代表人：卢长才
电话：0755—83199511
传真：0755—83199545
联系人：袁媛
咨询电话：0755—83199511
网站：www.csco.com.cn
43) 浙新证券有限责任公司
注册地址：杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6—7楼
办公地址：深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼
法定代表人：吴承根
电话：021—64718888
传真：021—64713795
联系人：李凌芳
客户服务热线：0571—967777
网站：www.stocke.com.cn
44) 华林证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼
办公地址：深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼
法定代表人：薛荣荣
联系人：王叶平
联系电话：0755—82707705
客服电话：400—880—2888
公司网站：www.chinalions.com
45) 日信证券有限责任公司
注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号长安金融中心西座11层

法定代表人：孔伯杰
联系人：苏江
电话：010—88086830—652
网站：www.rxzq.com.cn
46) 方正证券股份有限公司
注册地址：湖南长沙市芙蓉中路二段200号华侨国际大厦22—24层
办公地址：北京市西城区丰盛胡同20号太平洋保险大厦11层
法定代表人：雷杰
联系人：郭军瑞
联系电话：010—57398063
客户服务热线：96571
网站：www.founders.com.cn
47) 江海证券有限公司
注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路66号
办公地址：哈尔滨市香坊区赣水路66号
法定代表人：孙名扬
联系人：张青北
联系电话：0451—82336863
客服热线：4006662288
网站：www.jhzq.com.cn
48) 华西证券股份有限公司
注册地址：四川省成都市陕西街239号
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼
法定代表人：杨炯洋
联系人：谢国梅
联系电话：010—68716150
传真：028—86150615
客户服务咨询电话：400—8888—818
网站：www.hx168.com.cn
49) 红塔证券股份有限公司
注册地址：昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
办公地址：昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人：况雨林
联系人：刘晓明
电话：0871—3577942
客户服务电话：0871—3577930
网站：www.hongtazq.com
50) 长城瑞瑞证券有限公司
注册地址：福建省厦门市莲前西路2号连富大厦十七层
办公地址：福建省厦门市莲前西路2号连富大厦十七层
法定代表人：王勇
电话：0592—5161642
传真：0592—5161140
联系人：卢金文
客户服务电话：0592—5163588
网站：www.xmzq.cn
51) 银泰证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼
办公地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼
法定代表人：高颀
联系人：林文字
联系电话：0755—83703759
咨询电话：0755—83710885
公司网站：www.ytzzq.net
52) 华宝证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
法定代表人：陈林
联系人：刘闻川
客户服务电话：400—820—9898
网站：www.cnhstock.com
53) 爱建证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人：张建华
电话：(021) 32229888
传真：(021) 68728703
联系人：戴丽丽
客户服务电话：(021) 63340678
网站：www.aijzq.com
54) 国金证券股份有限公司
注册地址：成都市东城根上街95号
办公地址：成都市东城根上街95号
法定代表：冉云
联系人：刘婧茜
电话：028—86690057
传真：028—86690126
服务热线：4006—600109
公司网站：www.gjzq.com.cn
55) 信达证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区闹市口大街9号1号楼信达金融中心

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号1号楼信达金融中心
法定代表人：张志刚
联系人：唐静
联系电话：010—63080985
客服热线：400—800—8899
网站：www.cindasc.com
56) 华龙证券有限责任公司
注册地址：甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址：甘肃省兰州市东岗路638号财富大厦
法定代表人：李曉安
电话：0931—8888088
传真：0931—4890515
联系人：李昕田
客户服务电话：0931—4890619、4890618、4890100
网站：www.hlzqgs.com
57) 民生证券股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16—19层
办公地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16—19层
法定代表：余政
联系人：赵明
电话：010—85127622
服务热线：400—619—8888
公司网站：www.mszzq.com
58) 华福证券有限责任公司
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7—10层
法定代表人：黄金琳
邮政编码：350003
联系人：张腾
联系电话：0591—87383623
业务传真：0591—87383610
统一客户服务热线：96326 (福建省外请拨0591)
公司网站：www.hfzq.com.cn
59) 东兴证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12—15层
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12—15层
法定代表：陈勇力
联系人：汤漫川
电话：010—66555316
服务热线：4008888993
公司网站：www.dxzq.net
60) 国海证券股份有限公司
注册地址：广西南宁市滨湖路46号国海大厦
办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3F
法定代表人：张雅维
联系电话：0755—83709350
传真：0755—83704850
联系人：牛孟宇
网站：www.gkzq.com.cn

62) 西南证券股份有限公司
注册地址：重庆市江北区桥北苑8号
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人：余维佳
联系人：张煜
联系电话：023—63786141
客户服务电话：4008096096
传真：023—63786212
网站：www.swsc.com.cn
63) 新时代证券股份有限公司
注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人：刘汝军
联系人：马俊杰
电话：010—83561329
传真：010—83561094
邮编：100086
客户服务电话：4006989898
网站：www.xsdzq.com
64) 华鑫证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(15)单元
办公地址：上海市肇嘉浜路750号
法定代表人：俞洋
联系人：陈敏
电话：021—64339000
传真：021—54668902
客户服务电话：021—32109999; 029—68918888; 4001099918
网站：www.cfsc.com.cn
65) 联讯证券股份有限公司
注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路55号惠州广电大楼三、四层
办公地址：北京市朝阳区红旗营南路天畅园6号楼二层
法定代表人：徐刚
联系人：张俊
电话：010—64408820
传真：010—64408834
客户服务电话：95564
网站：www.lxzq.com.cn
66) 天风证券股份有限公司
注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼
办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人：余磊
联系人：崔成
电话：027—87610052
传真：027—87618963
客户服务电话：4008005000
网站：http://www.tfzq.com
67) 中国国际金融股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层

办公地址：北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
法定代表人：丁学东
电话：010—65051166
传真：010—85679203
联系人：杨晓宇
客户服务电话：400—910—1166
网站：www.cicc.com.cn
(3) 期货公司销售机构
1) 中信建投证券股份有限公司
注册地址：重庆市渝中区中山三路107号上站大楼平层11—B、名义11—A、8—B4、9—B、C
办公地址：重庆市渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼
法定代表人：彭文德
客户服务电话：400—8877—780
联系电话：023—86789742
联系人：潘琦
网站：www.cfci108.com
2) 中信期货有限公司
注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301—1305、14层
办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301—1305、14层
法定代表人：张皓
客服电话：400—990—8826
联系人：洪斌
联系电话：0755—23953913
网站：www.citicfsc.com
(4) 第三方销售机构
1) 上海天天基金销售有限公司
住所：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址：上海市徐汇区龙田路196号30C座10楼
法定代表人：其实
联系人：高利和
联系电话：020—87599527
客服电话：4008181888
网站：www.1234567.com.cn
2) 深圳众禄基金销售有限公司
注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人：薛峰
客服电话：4006—788—887
传真：0755—82080798
联系人：邓爱辉
网站：www.zlfund.cn、www.jmmw.com
3) 上海好买基金销售有限公司
办公地址：上海市浦东新区浦明路1118号鄂尔多斯大厦903—906室
住所：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
法定代表人：杨文斌
客服电话：400—700—9665
传真：021—50325989
联系人：蒋宾
网站：www.ehowbuy.com
4) 杭州数米基金销售有限公司
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
客服电话：4000—766—123
传真：0571—26698533
联系人：周娜曼
网站：www.fund123.cn
5) 上海长量基金销售投资顾问有限公司
办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人：张跃伟
客服电话：400—089—1289
传真：021—58787698
联系人：敖玲
电话：021—58788678—8201
传真：021—58787698
客服电话：400—089—1289
网站：www.erichfund.com
6) 北京展恒基金销售有限公司
办公地址：北京市朝阳区东四环中路66号裕鑫安富街6号
法定代表人：闫振斌
联系人：张晶晶
电话：(+86—10) 6202 0088 转8802
客服电话：400 888 6661
网站：www.myfund.com
7) 和讯信息科技有限公司
住所：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
联系人：于涛
联系电话：021—20835888
客服电话：400—920—0022
网站：licaike.hexun.com
8) 深圳市新华德证券投资咨询有限公司
住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
法定代表人：马永海
联系人：邓洁
联系电话：010—58321388—1105
客服电话：010—58325327
网站：jrxinlande.com
9) 北京增财基金销售有限公司
住所：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
法定代表人：王昌庆
联系人：罗国辉
联系电话：010—67000988
客服电话：400—001—8811
网站：www.zcvc.com.cn
10) 北京恒天明泽基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
办公地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路10号5层5122

室
法定代表人：黄永伟
联系人：侯仁黄
联系电话：010—57756068
客服电话：400—786—8868
网站：www.chtfund.com
11) 天相投资顾问有限公司办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
客服电话：010—66045678
联系人：林爽
网站：www.txsc.com.cn
12) 珠海盈米财富管理有限公司
住所：珠海市横琴新区宝华路6号105室—3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201—1203
法定代表人：肖雯
联系人：黄敏娜
联系电话：020—89629099

客服电话：020—89629096
网站：www.yingmi.cn
(二) 注册登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
联系人：崔巍
联系电话：010—59373856
传真：010—59378007
(三) 律师事务所与经办律师
名称：北京市德恒律师事务所
住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座12层
负责人：王丽
电话：(010) 66575898
传真：(010) 65232181
联系人：苏文卿
经办律师：陈静茹、苏文卿
(四) 会计师事务所与经办注册会计师
名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人：李丹
联系电话：(021) 23233888
传真：(021) 23238800
联系人：陈熹
经办注册会计师：单峰、陈熹
四、基金的名称
本基金名称：鹏华中证500开放式证券投资基金
五、基金的类型
本基金类型：混合型
六、基金的投资目标
以价值投资为主，通过集中投资于基本面和流动性良好同时收益价值或成长价值相对被低估的股票，长期持有结合适度波段操作，以求在充分控制风险的前提下分享中国经济成长成果和实现基金资产的长期稳定增值。
七、基金的投资方向
本基金以股票、中央银行票据、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具为主要投资方向。
八、基金的投资策略
1. 债券投资策略
本基金债券投资以降低组合总体波动性而改善组合风险结构为目的，采取积极主动的投资策略，谋取超额收益。如投资有需要则在严格控制风险的前提下通过回购参与有价值的新股配售和增发。
2. 股票投资策略
本基金股票投资中，精选个股，长期持有结合适度波段操作，注重长期收益。将类指数的选股方式与积极的重仓配置相结合，从而在保持了收益空间的前提下一定程度上降低了投资风险。股票价值分析兼重视收益和成长性。
具体流程是：首先选择全市场基本面流动性较好、流通市值较大的100只股票；由行业研究小组运用量化财务评级系统对其财务指标和资产价格的真实性进行评估，进一步筛选到80只；基金经理根据市场价格的波动情况，动态分析其价值低估程度，选择收益价值或成长价值相对被低估的50只左右的股票长期投资；为避免价值配置过于集中，由金融工程研究员对拟投资组合进行行业比例测算，如果个别行业的投资比例过高，则进行适当之调整。
3. 决策程序
投资决策委员会：确定本基金总体资产配置和投资策略。投资决策委员会定期召开会议，如需及时做出重大决策或经基金管理小组提议，可临时召开投资决策委员会会议。
金融工程研究及行业研究员：对于宏观经济、行业、上市公司、投资逻辑、金融工程、可投资股票备选库的建立与完善、投资风险控制与基金业绩评估等与投资决策有关的内容进行深入全面的分析，作为投资决策的依据。
基金管理团队：构造和调整投资组合。设计和调整投资组合需要综合考虑本因素包括：投资决策委员会决议、每日基金申购和赎回净现金流量、基金合同所设定的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断；绩效与投资小组的建议等。
集中交易室：基金经理向集中交易室下达投资指令，集中交易室经理向交易员分配交易指令，交易员执行投资指令。
绩效与风控评估小组：对基金投资组合进行绩效评估，对各种投资风格指标进行测量并向基金管理团队提出预警和调整建议。
监察稽核部：对投资组合的合法合规性进行监控。
九、基金的投资业绩比较基准
上证180指数涨跌幅×65%+中证100指数涨跌幅×30%+金融同业存款利率×5%
本基金主要以基本面和流动性良好同时收益价值或成长价值相对被低估的股票为投资对象，且股票投资数目有限，适合用成分指数对比为比较基准。而上证180指数和沪深300指数分别是上交所和深交所最主要的成分指数，分别代表了这两个交易所总市值和成交最大的一部分A股，成长性强，估值水平低，具有很高的投资价值。
本基金充分考虑本基金各资产投资比例要求从而构建上述业绩比较基准。
十、基金的风险收益特征
本基金属平衡型证券投资基金，为证券投资基金中的中风险品种。长期平均的风险和预期收益低于成长型基金，高于价值型基金、指数型基金、纯债券基金和国债。
十一、基金的投资组合报告(未经审计)
本基金管理人的董事会及董事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。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年10月22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。
本报告中列数据截至2015年9月30日，未经审计。
1. 报告期末基金资产组合情况

2. 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

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债券投资明细

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十名资产支持证券投资明细

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

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

7. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

9. 投资组合报告附注

10. 投资组合报告附注

11. 投资组合报告附注

12. 投资组合报告附注

13. 投资组合报告附注

14. 投资组合报告附注

15. 投资组合报告附注

16. 投资组合报告附注

17. 投资组合报告附注

18. 投资组合报告附注

19. 投资组合报告附注

20. 投资组合报告附注

21. 投资组合报告附注

22. 投资组合报告附注

23. 投资组合报告附注

24. 投资组合报告附注

25. 投资组合报告附注

26. 投资组合报告附注

27. 投资组合报告附注

28. 投资组合报告附注

29. 投资组合报告附注

30. 投资组合报告附注

31. 投资组合报告附注

32. 投资组合报告附注

33. 投资组合报告附注

34. 投资组合报告附注

35. 投资组合报告附注

36. 投资组合报告附注

37. 投资组合报告附注

38. 投资组合报告附注

39. 投资组合报告附注

40. 投资组合报告附注

41. 投资组合报告附注

42. 投资组合报告附注

43. 投资组合报告附注

44. 投资组合报告附注

45. 投资组合报告附注

46. 投资组合报告附注

47. 投资组合报告附注

48. 投资组合报告附注

49. 投资组合报告附注

50. 投资组合报告附注

51. 投资组合报告附注

52. 投资组合报告附注

53. 投资组合报告附注

54. 投资组合报告附注

55. 投资组合报告附注

56. 投资组合报告附注

57. 投资组合报告附注

58. 投资组合报告附注

59. 投资组合报告附注

60. 投资组合报告附注

61. 投资组合报告附注

62. 投资组合报告附注

63. 投资组合报告附注

64. 投资组合报告附注

65. 投资组合报告附注

66. 投资组合报告附注

67. 投资组合报告附注

68. 投资组合报告附注

69. 投资组合报告附注

70. 投资组合报告附注

71. 投资组合报告附注

72. 投资组合报告附注

73. 投资组合报告附注

74. 投资组合报告附注

75. 投资组合报告附注

76. 投资组合报告附注

77. 投资组合报告附注

78. 投资组合报告附注

79. 投资组合报告附注

80. 投资组合报告附注

81. 投资组合报告附注

82. 投资组合报告附注

83. 投资组合报告附注

84. 投资组合报告附注

85. 投资组合报告附注

86. 投资组合报告附注

87. 投资组合报告附注

88. 投资组合报告附注

89. 投资组合报告附注

90. 投资组合报告附注

91. 投资组合报告附注

92. 投资组合报告附注

93. 投资组合报告附注

94. 投资组合报告附注

95. 投资组合报告附注

96. 投资组合报告附注

97. 投资组合报告附注

98. 投资组合报告附注

99. 投资组合报告附注

100. 投资组合报告附注

101. 投资组合报告附注

102. 投资组合报告附注

103. 投资组合报告附注

104. 投资组合报告附注

105. 投资组合报告附注

106. 投资组合报告附注

107. 投资组合报告附注

108. 投资组合报告附注

109. 投资组合报告附注

110. 投资组合报告附注

111. 投资组合报告附注

112. 投资组合报告附注

113. 投资组合报告附注

114. 投资组合报告附注

115. 投资组合报告附注

116. 投资组合报告附注

117. 投资组合报告附注

118. 投资组合报告附注

119. 投资组合报告附注

120. 投资组合报告附注

121. 投资组合报告附注

122. 投资组合报告附注

123. 投资组合报告附注

124. 投资组合报告附注

125. 投资组合报告附注

126. 投资组合报告附注

127. 投资组合报告附注

128. 投资组合报告附注

129. 投资组合报告附注

130. 投资组合报告附注

131. 投资组合报告附注

132. 投资组合报告附注

133. 投资组合报告附注

134. 投资组合报告附注

135. 投资组合报告附注

136. 投资组合报告附注

137. 投资组合报告附注

138. 投资组合报告附注

139. 投资组合报告附注

1