

**(上接 D25 版)**

80 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号院1号楼信达金融中心  
法定代表人:高冠江  
联系人:陈静  
电话:010-63080985  
客服电话:400-800-8899  
网址:www.cindasc.com

81 国信证券股份有限公司  
注册地址:广东省深圳市红岭中路1013号国信大厦18楼  
法定代表人:何如  
联系人:李慧  
电话:0755-83799551  
客服电话:95508  
网址:www.guosen.com.cn

82 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16-18层  
法定代表人:余政  
联系人:杨明  
电话:010-85172222  
客服电话:400-619-8888  
网址:www.msjz.com

83 华泰证券股份有限公司  
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层  
法定代表人:吴万善  
联系人:陈琳  
电话:0591-8783610  
客服电话:96326  
网址:www.htsc.com.cn

84 光大证券股份有限公司  
注册地址:北京市西城区金融大街9号5层光大证券大厦  
法定代表人:薛峰  
联系人:李娟  
电话:010-65953646  
客服电话:95502  
网址:www.ebscn.com

85 招商证券股份有限公司  
注册地址:深圳市福田区益田路5003号招商证券大厦24楼  
法定代表人:宫少林  
联系人:魏强  
电话:0755-83737343  
客服电话:95565  
网址:www.newchina.com.cn

86 兴业证券股份有限公司  
注册地址:福州市湖东路154号新天地大厦7、8层  
法定代表人:兰荣  
联系人:曾文  
电话:0591-8783610  
客服电话:96326  
网址:www.xyzq.com.cn

87 国元证券股份有限公司  
注册地址:安徽省合肥市寿春路179号  
法定代表人:陈少平  
联系人:李杰  
电话:0551-62256000  
客服电话:95508  
网址:www.guoyuan.com.cn

88 方正证券股份有限公司  
注册地址:吉林省长春市净月大街2511号  
法定代表人:孙优  
联系人:李洪岩  
电话:0431-85096223  
客服电话:95352  
网址:www.fund123.com

89 天风证券股份有限公司  
注册地址:武汉市中南路99号武汉国际广场写字楼40楼  
法定代表人:余刚  
联系人:姜黎黎  
电话:027-63767414  
客服电话:4008096969  
网址:www.tfzq.com

90 华融证券股份有限公司  
注册地址:北京市西城区金融大街8号  
法定代表人:宋德坤  
联系人:李海峰  
电话:010-83561294  
客服电话:4006998988  
网址:www.hr30.com.cn

91 天相投资顾问有限公司  
注册地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座701  
法定代表人:林义相  
联系人:林文斌  
电话:010-66045491  
客服电话:010-66045678  
网址:www.txsec.com

92 国联证券股份有限公司  
注册地址:江苏省无锡市太湖新城金融城99号11楼  
法定代表人:姚志勇  
联系人:李海峰  
电话:0510-83621000  
客服电话:400-700-9665  
网址:www.glsc.com.cn

93 上海国泰君安证券集团  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1601号16楼  
法定代表人:王松华  
联系人:李海峰  
电话:021-38896666  
客服电话:400-700-9665  
网址:www.gtja.com

94 上海东方证券集团  
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1601号16楼  
法定代表人:王松华  
联系人:李海峰  
电话:021-38896666  
客服电话:400-700-9665  
网址:www.gtja.com

95 北京首创证券集团  
注册地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座701  
法定代表人:林义相  
联系人:林文斌  
电话:010-66045491  
客服电话:010-66045678  
网址:www.txsec.com

96 北京首创证券集团  
注册地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座701  
法定代表人:林义相  
联系人:林文斌  
电话:010-66045491  
客服电话:010-66045678  
网址:www.txsec.com

97 北京首创证券集团  
注册地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座701  
法定代表人:林义相  
联系人:林文斌  
电话:010-66045491  
客服电话:010-66045678  
网址:www.txsec.com

98 北京首创证券集团  
注册地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座701  
法定代表人:林义相  
联系人:林文斌  
电话:010-66045491  
客服电话:010-66045678  
网址:www.txsec.com

99 北京首创证券集团  
注册地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座701  
法定代表人:林义相  
联系人:林文斌  
电话:010-66045491  
客服电话:010-66045678  
网址:www.txsec.com

100 北京首创证券集团  
注册地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座701  
法定代表人:林义相  
联系人:林文斌  
电话:010-66045491  
客服电话:010-66045678  
网址:www.txsec.com

网址:www.fund123.com

C. 注册登记机构  
名称:中国证券登记结算有限责任公司  
住所:北京西城区德胜门内大街2号  
法定代表人:金磊  
电话:010-58588899  
传真:010-58598007  
联系人:宋元元  
E: 注册服务与经办注册  
联系人:李海峰  
地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层  
办公地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层  
电话:010-66575888  
传真:010-66212181  
联系人:苏文婷  
E: 注册服务与经办注册  
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司  
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1118号嘉里中心4楼6楼  
办公地址:上海市南汇路202号普华永道中11楼  
法定代表人:杨绍明  
电话:021-22328888  
E: 注册服务与经办注册  
联系人:魏强

四、基金名称  
五、基金的类型  
六、基金的投资目标  
七、基金的投资方向  
八、基金的风险收益特征

本基金名称:鹏华中证50开放式证券投资基金  
本基金类型:混合型

以价值投资为主,通过集中投资于基本面和成长性并兼具估值优势的个股,长期持有结合适度波段操作,以求充分挖掘个股的长期价值并分享中国宏观经济长期增长带来的长期稳定回报。

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。

1. 股票投资  
本基金采取以自下而上选股策略,从宏观经济、行业景气度、公司成长性、估值水平等方面,选择具有长期增长潜力的个股进行投资,并适度波段操作,以求充分挖掘个股的长期价值并分享中国宏观经济长期增长带来的长期稳定回报。

2. 债券投资  
本基金在债券投资中,综合考虑中长期利率走势、信用风险、流动性等因素,选择具有长期增长潜力的个股进行投资,并适度波段操作,以求充分挖掘个股的长期价值并分享中国宏观经济长期增长带来的长期稳定回报。

3. 其他资产  
本基金在法律法规允许的范围内,可投资于权证、股指期货、国债期货等金融衍生品,以对冲市场风险,提高投资组合的稳定性。

4. 风险管理  
本基金通过建立科学的风险管理体系,采用定量和定性相结合的方法,对投资组合进行全方位的风险评估,确保投资组合的风险水平符合基金合同约定。

5. 业绩比较基准  
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*60%+中证500指数收益率\*40%。

6. 基金管理人承诺  
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,也不保证基金最低收益。基金管理人将根据基金合同约定,为基金份额持有人谋求长期稳定的投资回报。

本基金名称:鹏华中证50开放式证券投资基金  
本基金类型:混合型

以价值投资为主,通过集中投资于基本面和成长性并兼具估值优势的个股,长期持有结合适度波段操作,以求充分挖掘个股的长期价值并分享中国宏观经济长期增长带来的长期稳定回报。

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。

1. 股票投资  
本基金采取以自下而上选股策略,从宏观经济、行业景气度、公司成长性、估值水平等方面,选择具有长期增长潜力的个股进行投资,并适度波段操作,以求充分挖掘个股的长期价值并分享中国宏观经济长期增长带来的长期稳定回报。

2. 债券投资  
本基金在债券投资中,综合考虑中长期利率走势、信用风险、流动性等因素,选择具有长期增长潜力的个股进行投资,并适度波段操作,以求充分挖掘个股的长期价值并分享中国宏观经济长期增长带来的长期稳定回报。

3. 其他资产  
本基金在法律法规允许的范围内,可投资于权证、股指期货、国债期货等金融衍生品,以对冲市场风险,提高投资组合的稳定性。

4. 风险管理  
本基金通过建立科学的风险管理体系,采用定量和定性相结合的方法,对投资组合进行全方位的风险评估,确保投资组合的风险水平符合基金合同约定。

5. 业绩比较基准  
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*60%+中证500指数收益率\*40%。

6. 基金管理人承诺  
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,也不保证基金最低收益。基金管理人将根据基金合同约定,为基金份额持有人谋求长期稳定的投资回报。

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000085	五粮液	8,549,859	239,440,220.10	7.24
2	000568	泸州老窖	6,051,118	232,991,143.00	5.82
3	401166	兴业银行	11,199,836	144,118,036.36	3.60
4	000022	万科A	10,000,000	84,300,000.00	2.11
5	600199	金种子酒	3,838,989	81,770,465.70	2.04
6	600535	上汽集团	1,518,138	78,093,018.72	1.95
7	600104	天然气	5,299,817	71,759,522.18	1.79
8	000963	华东医药	2,063,854	71,202,963.00	1.78
9	600048	保利地产	6,399,952	68,863,483.52	1.72
10	002250	联化科技	3,513,028	66,044,926.40	1.65

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1101094	11央行票据94	3,600,000	348,120,000.00	8.70
2	1101088	11央行票据88	2,800,000	270,676,000.00	6.76
3	1001037	10央行票据37	1,000,000	99,820,000.00	2.49
4	120228	12国债28	1,000,000	98,760,000.00	2.49
5	120229	12国债29	1,000,000	98,760,000.00	2.47

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,217,137,633.49	55.26
2	其中:股票	2,217,137,633.49	55.26
3	其中:债券	1,105,957,173.50	27.56
4	其中:其他资产	1,105,957,173.50	27.56
5	银行存款和结算备付金合计	662,105,416.22	16.50
6	其他资产	27,280,897.16	0.68
7	合计	4,012,481,120.37	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	23,119,156.00	0.58
B	采掘业	30,538,253.58	2.28
C	制造业	1,667,458,944.02	31.68
CO	食品饮料	1,287,118,940.40	17.07
C1	纺织服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	108,794,641.40	2.72
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	19,955,210.88	0.50
C7	机械、设备、仪表	147,251,773.03	3.68
C8	医药、生物制品	300,338,369.31	7.61
O99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	12,292,422.40	0.31
E	建筑业	159,562,083.01	0.49
F	交通运输、仓储业	109,912,711.06	2.75
G	信息技术业	89,294,974.14	2.23
H	批发和零售业	265,486,227.54	6.64
I	房地产业	32,111,753.44	0.80
J	社会服务业	17,815,089.68	0.45
K	传播与文化业	-	-
L	综合类	-	-
M	合计	2,217,137,633.49	55.41

二、注册登记机构  
名称:中国证券登记结算有限责任公司  
住所:北京西城区德胜门内大街2号  
法定代表人:金磊  
电话:010-58588899  
传真:010-58598007  
联系人:宋元元  
E: 注册服务与经办注册  
联系人:李海峰  
地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层  
办公地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层  
电话:010-66575888  
传真:010-66212181  
联系人:苏文婷  
E: 注册服务与经办注册  
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司  
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1118号嘉里中心4楼6楼  
办公地址:上海市南汇路202号普华永道中11楼  
法定代表人:杨绍明  
电话:021-22328888  
E: 注册服务与经办注册  
联系人:魏强

三、具有法律意见书的律师事务所  
名称:上海锦天城律师事务所  
住所:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心9楼  
法定代表人:廖海斌  
联系人:李海峰  
电话:021-58896666  
传真:021-58896666  
地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心9楼  
法定代表人:廖海斌  
联系人:李海峰  
电话:021-58896666  
传真:021-58896666

四、基金名称  
鹏华中证500开放式证券投资基金  
五、基金的类型  
混合型证券投资基金  
六、基金的投资目标  
本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深300指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场公开发行或增发)、可转债、股票投资比例不低于基金资产的90%,投资于沪深300指数的成份股和备选成份股的投资不低于股票资产的80%,其中备选成份股的投资比例不高于25%。本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。  
本基金还可以投资于经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具。在履行适当程序后,本基金可以将其纳入投资范围。

七、投资范围  
本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深300指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场公开发行或增发)、可转债、股票投资比例不低于基金资产的90%,投资于沪深300指数的成份股和备选成份股的投资不低于股票资产的80%,其中备选成份股的投资比例不高于25%。本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。  
本基金还可以投资于经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具。在履行适当程序后,本基金可以将其纳入投资范围。

八、投资策略  
本基金采取被动式指数化投资方式,实现与市场的同步增长,获取中国经济增长的长期稳定回报。

九、投资策略  
本基金为以完全复制为目标的指数基金,按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。

十、业绩比较基准  
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*60%+中证500指数收益率\*40%。

五、基金的投资目标  
本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深300指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场公开发行或增发)、可转债、股票投资比例不低于基金资产的90%,投资于沪深300指数的成份股和备选成份股的投资不低于股票资产的80%,其中备选成份股的投资比例不高于25%。本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。  
本基金还可以投资于经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具。在履行适当程序后,本基金可以将其纳入投资范围。

六、基金的投资范围  
本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深300指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场公开发行或增发)、可转债、股票投资比例不低于基金资产的90%,投资于沪深300指数的成份股和备选成份股的投资不低于股票资产的80%,其中备选成份股的投资比例不高于25%。本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。  
本基金还可以投资于经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具。在履行适当程序后,本基金可以将其纳入投资范围。

七、基金的投资策略  
本基金采取被动式指数化投资方式,实现与市场的同步增长,获取中国经济增长的长期稳定回报。

八、基金的投资策略  
本基金为以完全复制为目标的指数基金,按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。

九、基金的业绩比较基准  
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*60%+中证500指数收益率\*40%。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	4,931,110,134.78	85.11
2	其中:股票	4,931,110,134.78	85.11
3	其中:债券	63,106,388.00	1.09
4	其中:其他资产	63,106,388.00	1.09
5	银行存款和结算备付金合计	615,142,121.30	10.62
6	其他资产	184,272,472.12	3.18
7	合计	5,793,631,041.20	100.00

六、基金管理人承诺  
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,也不保证基金最低收益。基金管理人将根据基金合同约定,为基金份额持有人谋求长期稳定的投资回报。

七、基金的投资策略  
本基金采取被动式指数化投资方式,实现与市场的同步增长,获取中国经济增长的长期稳定回报。

八、基金的投资策略  
本基金为以完全复制为目标的指数基金,按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。

九、基金的业绩比较基准  
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*60%+中证500指数收益率\*40%。

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1101094	11央行票据94	3,600,000	348,120,000.00	8.70
2	1101088	11央行票据88	2,800,000	270,676,000.00	6.76
3	1001037	10央行票据37	1,000,000	99,820,000.00	2.49
4	120228	12国债28	1,000,000	98,760,000.00	2.49
5	120229	12国债29	1,000,000	98,760,000.00	2.47

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,217,137,633.49	55.26
2	其中:股票	2,217,137,633.49	55.26
3	其中:债券	1,105,957,173.50	27.56
4	其中:其他资产	1,105,957,173.50	27.56
5	银行存款和结算备付金合计	662,105,416.22	16.50
6	其他资产	27,280,897.16	0.68
7	合计	4,012,481,120.37	100.00

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	23,119,156.00	0.58
B	采掘业	30,538,253.58	2.28
C	制造业	1,667,458,944.02	31.68
CO	食品饮料	1,287,118,940.40	17.07
C1	纺织服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	108,794,641.40	2.72
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	19,955,210.88	0.50
C7	机械、设备、仪表	147,251,773.03	3.68
C8	医药、生物制品	300,338,369.31	7.61
O99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	12,292,422.40	0.31
E	建筑业	159,562,083.01	0.49
F	交通运输、仓储业	109,912,711.06	2.75
G	信息技术业	89,294,974.14	2.23
H	批发和零售业	265,486,227.54	6.64
I	房地产业	32,111,753.44	0.80
J	社会服务业	17,815,089.68	0.45
K	传播与文化业	-	-
L	综合类	-	-
M	合计	2,217,137,633.49	55.41

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	银行存款	1,255,036.67	0.56
2	应收证券清算款	-	-
3	应收股利	644,202.85	0.16
4	应收利息	25,065,771.15	0.63
5	应收申购款	315,886.49	0.08
6	其他应收款	-	-
7	待摊费用	-	-
8	其他	-	-
9	合计	27,280,897.16	0.68

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	银行存款	1,255,036.67	0.56
2	应收证券清算款	-	-
3	应收股利	644,202.85	0.16
4	应收利息	25,065,771.15	0.63
5	应收申购款	315,886.49	0.08
6	其他应收款	-	-
7	待摊费用	-	-
8	其他	-	-
9	合计	27,280,897.16	0.68

净值增长率1	净值增长率2	业绩比较基准收益率3	业绩比较基准收益率标准差4	1-3	2-4	
2004年5月12日至2004年12月31日	-4.90%	0.68%	-13.42%	1.09%	8.52%	-0.41%
2005年1月1日至2005年12月31日	5.15%	0.89%	-7.45%	1.28%	12.60%	-0.39%
2006年1月1日至2006年12月31日	15.92%	1.30%	-11.25%	1.34%	42.72%	-0.04%
2007年1月1日至2007年12月31日	127.81%	1.98%	149.71%	2.18%	-21.90%	-0.20%
2008年1月1日至2008年12月31日	-48.86%	2.08%	-63.21%	2.89%	14.35%	-0.81%
2009年1月1日至2009年12月31日	73.87%	1.57%	92.86%	1.97%	-18.99%	-0.40%
2010年1月1日至2010年12月31日	3.58%	1.26%	-11.40%	1.51%	14.98%	-0.25%
2011年1月1日至2011年12月31日	-23.88%	1.09%	-24.24%	1.25%	0.36%	-0.16%
2012年1月1日至2012年9月30日	2.68%					