

## 鹏华中证500指数证券投资基金(LOF)

### 2015 半年度 报告摘要

2015年6月30日

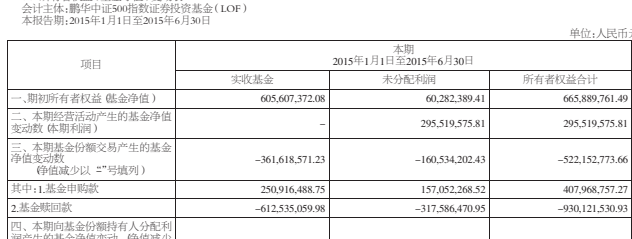
资产负债表		
	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产:		
货币资金	3,415,426.00	6,480,317.77
交易性金融资产	358,211.89	439,326.62
应收利息	71,642.38	87,865.31
其他资产	526,227.37	871,692.32
负债:		
应付赎回款	659,616.28	430,321.46
应付管理人报酬	35,767,125.52	8,399,523.48
其他负债	-	-
所有者权益:		
基金份额持有人权益	243,988,800.85	605,607,372.08
未分配利润	195,267,762.79	662,889,761.49
所有者权益合计	470,252,689.16	674,199,247.97

损益表		
	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入	30,914,660.90	10,828,236.01
1.利息收入	142,201.36	159,979.32
2.投资收益	142,201.36	159,979.32
3.公允价值变动收益	-	181.30
4.其他收入	-	-
二、费用	-	-
1.基金管理费	-	-
2.基金托管费	-	-
3.销售服务费	-	-
4.其他费用	-	-
三、利润总额	30,914,660.90	10,828,236.01
四、净利润	30,914,660.90	10,828,236.01

现金流量表		
	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、经营活动产生的现金流量	3,458,166.79	3,116,724.99
二、投资活动产生的现金流量	-	-
三、筹资活动产生的现金流量	-	-
四、汇率变动对现金的影响	-	-
五、现金及现金等价物净增加额	3,458,166.79	3,116,724.99

所有者权益变动表		
	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、基金份额持有人权益	243,988,800.85	605,607,372.08
二、未分配利润	195,267,762.79	662,889,761.49
三、所有者权益合计	470,252,689.16	674,199,247.97

基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较			
期间	基金净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②
过去一个月	3.79%	-10.07%	3.69%
过去三个月	22.37%	2.86%	21.79%
过去六个月	63.64%	2.24%	63.35%
过去一年	123.88%	1.79%	118.25%
过去三年	147.25%	1.26%	146.05%
自基金合同生效以来	80.09%	1.52%	97.01%



基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人  
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

投资组合				
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(%)
000066	长电科技	1683	78,912	1.66
000519	江皖高速	2606	13,800	0.29
000049	科锐光电	2136	82,830	1.76
000566	恒瑞医药	4997	26,977	0.58
000650	仁东控股	1717	46,286	0.98
000688	建发股份	3772	17,466	0.37
000969	赣锋锂业	1707	68,099	1.45
000993	华神集团	2037	22,635	0.48
000977	金石有色	3383	27,477	0.58
000742	泰禾集团	3036	30,778	0.65
000738	长城信息	2725	40,200	0.85
000786	北新建材	1913	18,224	0.39
000788	北汽控股	2072	18,685	0.40
000858	华谊股份	1098	41,406	0.88
000887	中顺纸业	2475	35,098	0.74
000909	中信证券	619	18,500	0.39
000972	中银国际	604	12,584	0.27
000982	中国国旅	901	11,828	0.25
010696	华神集团	1725	15,531	0.33
020308	华谊集团	4408	29,500	0.62
020319	宇信科技	1976	17,900	0.38
020361	江苏国信	2622	13,550	0.29
021006	莱宝高科	1642	53,800	1.14
2.投资控股(截止2015年6月30日)	24,017,912.00	33.50	47,087,222	100.00
其中:投资控股(截止2015年6月30日)	24,017,912.00	33.50	47,087,222	100.00
基金投资收益	30,914,660.90	65.78	37,400	0.08
021283	普鲁道夫	2015年6月11日	1,016,858.58	-
021291	德盛股份	2015年6月18日	1,080,628.28	-
021294	武汉凡谷	2015年6月18日	1,479,321.12	-
021298	海悦股份	2015年6月18日	1,370,896.36	-
021303	保利地产	2015年6月18日	1,498,198.71	-
021325	公共事业(截止2015年6月30日)	35,003,741.11	-8,568,813.42	-
4.1.1 公允价值变动收益(截止2015年6月30日)	79,974.35	332,837.87	-	
5.其他收入(截止2015年6月30日)	6,423,005.42	2,333,803.54	-	
减:二、费用	6,423,005.42	44,027.52	-	
1.管理费	6,423,005.42	2,210,237.45	-	
2.托管费	6,423,005.42	44,027.52	-	
3.销售服务费	-	-	-	
4.其他费用	-	-	-	
5.利息支出	-	-	-	
6.其他费用	-	-	-	
三、利润总额	29,519,575.81	12,766,963.28	-	
减:所得税	-	-	-	
四、净利润	29,519,575.81	12,766,963.28	-	

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人  
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

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人

基金管理人及基金托管人	
姓名	职务
王辉	基金管理人
李强	基金托管人