

鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）

2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

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

送出日期：2019 年 8 月 23 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2019 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华优质治理混合（LOF）
场内简称	鹏华治理
基金主代码	160611
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2007 年 4 月 25 日
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
报告期末基金份额总额	1,168,602,031.27 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007 年 7 月 18 日

2.2 基金产品说明

投资目标	投资于具有相对完善的公司治理结构和良好成长性的优质上市公司，为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	（1）股票投资策略：本基金采取“自上而下”的资产配置和“自下而上”的选股策略相结合的主动投资管理策略。整体资产和行业配置主要根据宏观经济、政策环境及行业发展不同阶段、不同特点等情况确定股票投资比例和行业配置比例，个股方面，主要投资于具有相对完善的公司治理结构和良好成长性的优质上市公司，同时关注那些过去基本面较差但正在发生转折的上市公司，采用多种价值评估方法，多视角地进行分析，努力选择最具有投资价值的公司进行投资。（2）债券投资策略：本基金的债券投资采用久期控制下的主动投资策略，本着风险收益匹配最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的配置比例。在个券选择上，本基金综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用等级分析、流动性评估等方法来评估个券的投资价值。（3）权证投资策略：本基金将权证看作是辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币型基金、债券基金，低于股票型基金，为证券投资基金中具有中高风险、中高收益的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张戈	郭明
	联系电话	0755-82825720	010-66105799

电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	4006788999	95588
传真	0755-82021126	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	132,448,373.63
本期利润	173,316,590.94
加权平均基金份额本期利润	0.1456
本期基金份额净值增长率	21.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1718
期末基金资产净值	967,892,906.32
期末基金份额净值	0.828

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）扣除相关费用后的余额，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) 所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），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

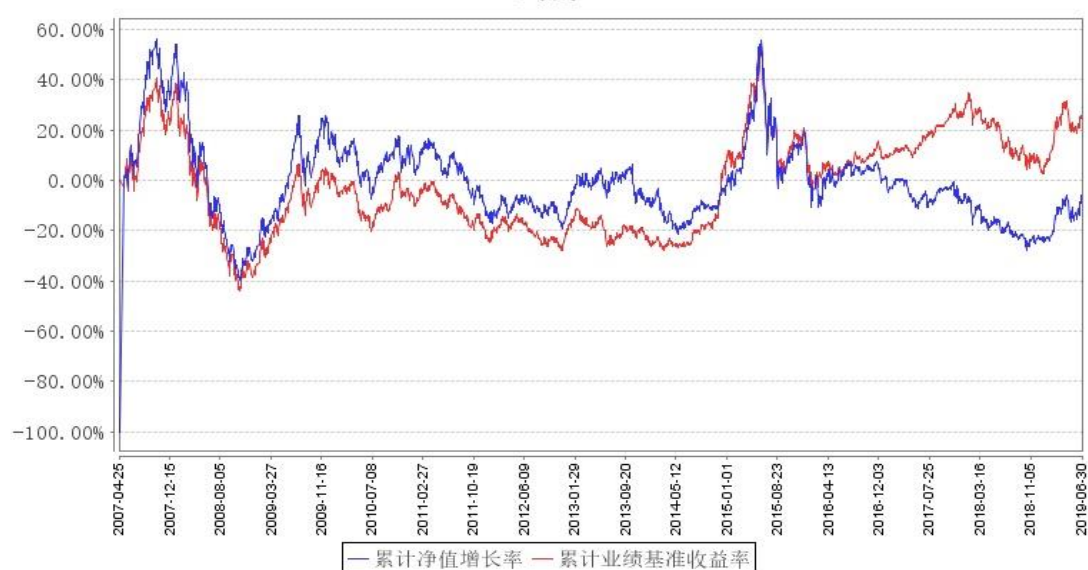
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	8.38%	1.40%	4.18%	0.87%	4.20%	0.53%
过去三个月	6.02%	1.79%	-0.61%	1.14%	6.63%	0.65%

过去六个月	21.23%	1.56%	20.61%	1.16%	0.62%	0.40%
过去一年	15.64%	1.28%	8.81%	1.14%	6.83%	0.14%
过去三年	-10.49%	1.07%	19.71%	0.83%	-30.20%	0.24%
自基金成立 起至今	-6.12%	1.52%	25.27%	1.33%	-31.39%	0.19%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

鹏华优质治理混合（LOF）累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2007 年 04 月 25 日生效。2、截至建仓期结束，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。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业。公司原注册资本 8,000 万元人民币，后于 2001 年 9 月完成增资扩股，增至 15,000 万元人民币。截止到 2019 年 6 月，公司管理资产总规模达到 5,644.95 亿元，管理 159 只公募基金、10 只全国社保投资组合、4 只基本养老保险投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈璇淼	本基金基金经理	2018-08-01	-	7	陈璇淼女士，国籍中国，经济学硕士，7 年证券基金从业经验。2012 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事行业研究工作，历任研究部基金经理助理/高级研究员，现担任权益投资二部基金经理。2016 年 03 月担任鹏华外延成长混合基金基金经理，2017 年 11 月担任鹏华优势企业基金基金经理，2018 年 08 月担任鹏华优质治理混合（LOF）基金基金经理。陈璇淼女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，郑川江不再担任本基金基金经理。
郑川江	本基金基金经理	2017-07-29	2019-04-03	10	郑川江先生，国籍中国，经济学硕士，10

					年证券投资基金从业经验。历任鹏华基金管理有限公司研究员，长城证券研究所研究员、所长助理；2015年2月加盟鹏华基金管理有限公司，任职于研究部，从事行业研究工作。2015年06月担任鹏华环保产业股票基金基金经理，2016年01月至2017年03月担任鹏华健康环保混合基金基金经理，2016年06月至2019年04月担任鹏华动力增长混合（LOF）基金基金经理，2017年04月至2017年09月担任鹏华新能源产业混合基金基金经理，2017年07月至2019年04月担任鹏华优质治理混合（LOF）基金基金经理，2019年04月担任鹏华优选回报混合基金基金经理。郑川江先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，郑川江不再担任本基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同

和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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、分配等各环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年宏观经济走势比较平稳，各个板块的景气发生分化，其中通信、农业、高端酒、医药 CRO 等板块表现出上行的景气，家电、汽车、智能手机、定制家居等板块表现出下行的景气，鹏华优质治理坚持组合分散，个股集中，将组合配置在食品、医药、农业、电子、通信、轻工等各个行业的优质个股，坚持价值投资，精选优秀龙头个股买入并且持有。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

鹏华优质治理混合（LOF）组合净值增长率 21.23%；业绩比较基准增长率 20.61%。同期上证综指涨跌幅为 19.4468%，深证成指涨跌幅为 26.7760%，沪深 300 指数涨跌幅为 27.0683%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年下半年，我们认为宏观经济平稳的主基调不会变，强地产投资，弱基建及制造业投资格局变化不大，鹏华优质治理坚持精选各个景气板块的龙头个股，分散行业投资，获取超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

（1）日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及账务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银

行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

（2）特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4. 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金可供分配利润为-200,709,124.95 元，期末基金份额净值 0.828 元，不符合利润分配条件。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）的管理人——鹏华基金管理有限公司在鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回

价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）本半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产		本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款		102,671,745.75	46,734,952.71
结算备付金		462,805.18	17,985,675.86
存出保证金		602,171.50	538,593.41
交易性金融资产		868,557,635.63	680,164,484.48
其中：股票投资		868,557,635.63	680,164,484.48
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产		—	—
买入返售金融资产		—	—
应收证券清算款		—	103,496,378.07
应收利息		19,814.91	253.24
应收股利		—	—
应收申购款		58,389.36	6,435.32
递延所得税资产		—	—
其他资产		—	—
资产总计		972,372,562.33	848,926,773.09
负债和所有者权益		本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		—	—

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	20,108,134.53
应付赎回款		935,697.55	137,412.46
应付管理人报酬		1,126,134.92	1,043,401.86
应付托管费		187,689.15	173,900.30
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,557,215.07	840,596.44
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		672,919.32	716,756.87
负债合计		4,479,656.01	23,020,202.46
所有者权益：			
实收基金		1,168,602,031.27	1,208,924,849.98
未分配利润		-200,709,124.95	-383,018,279.35
所有者权益合计		967,892,906.32	825,906,570.63
负债和所有者权益总计		972,372,562.33	848,926,773.09

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.828 元，基金份额总额 1,168,602,031.27 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		187,826,797.97	-104,597,462.82
1. 利息收入		572,310.97	1,065,054.90
其中：存款利息收入		534,681.28	604,240.61
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		37,629.69	460,814.29
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		146,374,756.03	-91,663,922.89
其中：股票投资收益		139,646,888.90	-98,124,530.93

基金投资收益			-
债券投资收益			-
资产支持证券投资收益			-
贵金属投资收益			-
衍生工具收益			-
股利收益		6,727,867.13	6,460,608.04
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		40,868,217.31	-14,006,898.08
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）			-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		11,513.66	8,303.25
减：二、费用		14,510,207.03	14,119,150.22
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	6,653,564.86	7,045,570.45
2. 托管费	6.4.8.2.2	1,108,927.43	1,174,261.74
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		6,577,380.19	5,654,381.11
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用		170,334.55	244,936.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		173,316,590.94	-118,716,613.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		173,316,590.94	-118,716,613.04

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,208,924,849.98	-383,018,279.35	825,906,570.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	173,316,590.94	173,316,590.94
三、本期基金份额交易产生的基	-40,322,818.71	8,992,563.46	-31,330,255.25

金净值变动数 （净值减少以 “-”号填列）			
其中：1. 基金申 购款	6,080,609.77	-1,405,823.17	4,674,786.60
2. 基金赎 回款	-46,403,428.48	10,398,386.63	-36,005,041.85
四、本期向基金 份额持有人分配 利润产生的基金 净值变动（净值 减少以“-”号填 列）	-	-	-
五、期末所有者 权益（基金净值）	1,168,602,031.27	-200,709,124.95	967,892,906.32
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者 权益（基金净值）	1,283,385,727.36	-241,991,299.03	1,041,394,428.33
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数（本期 利润）	-	-118,716,613.04	-118,716,613.04
三、本期基金份 额交易产生的基 金净值变动数 （净值减少以 “-”号填列）	-56,933,243.79	12,183,907.25	-44,749,336.54
其中：1. 基金申 购款	9,695,086.80	-2,283,417.22	7,411,669.58
2. 基金赎 回款	-66,628,330.59	14,467,324.47	-52,161,006.12
四、本期向基金 份额持有人分配 利润产生的基金 净值变动（净值 减少以“-”号填 列）	-	-	-
五、期末所有者 权益（基金净值）	1,226,452,483.57	-348,524,004.82	877,928,478.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明苏波郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）由普润证券投资基金及普华证券投资基金转型而成。根据原普润证券投资基金（“普润基金”）基金份额持有人大会审议通过的《关于普润证券投资基金转换基金运作方式有关事项的议案》和原普华证券投资基金（“普华基金”）基金份额持有人大会审议通过的《关于普华证券投资基金转换基金运作方式有关事项的议案》，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2007]100 号《关于核准普润证券投资基金基金份额持有人大会的批复》、证监基金字[2007]101 号《关于核准普华证券投资基金基金份额持有人大会的批复》及上海证券交易所上证债字[2007]25 号《关于终止普润证券投资基金上市的决定》、深圳证券交易所深证复[2007]22 号《关于同意普华证券投资基金终止上市并转型为上市开放式基金的批复》的同意，基金普润及基金普华于 2007 年 4 月 25 日终止上市。原《普润证券投资基金基金合同》及原《普华证券投资基金基金合同》于终止上市日起失效，《鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）基金合同》于同日起生效。原普润证券投资基金及原普华证券投资基金于 2007 年 5 月 15 日并入鹏华优质治理混合型证券投资基金，进行资产合并。原基金普润及原基金普华在 5 月 14 日基金份额转换基准日经审计的基金净值分别为 1,295,520,211.38 元和 1,204,163,435.07 元，原基金普润及原基金普华已将所实现的全部收益在 5 月 14 日转换基准日转换成基金份额。基金普润转换比例为 1:2.5910404，基金普华转换比例为 1:2.4083268。本基金自 2007 年 5 月 8 日至 2007 年 5 月 9 日期间进行集中申购，集中申购资金不包括利息为 9,382,669,143.08 元，折合 9,382,669,143.08 份基金份额，申购资金在集中申购期产生的利息为 1,571,880.73 元，折合 1,571,608.08 份基金份额，折算差额 272.65 元计入基金资产，经安永华明会计师事务所有限公司安永华明(2007)验字第 60468989_H01 号验资报告予以验证，并已向中国证监会备案。鹏华治理基金的运作方式为上市契约型开放式，存续期限不定。鹏华治理基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2007]第 109 号文审核同意，本基金 2,512,802,220.00 份基金份额于 2007 年 7 月 18 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过本基金代销机构赎回或通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后进行上市交易。

为符合 2014 年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》中关于不同基金类别所适用投资比例的规定，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及相关基金合同的有关规定，经协商相关基金托管人同意，并报中国证监会备案，鹏华基金管理有限公司决定自 2015 年 8 月 3 日起，将“鹏华优质治理股票型证券投资基金（LOF）”更名为“鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）”，基金类别由股票型证券投资基金变更为混合型证券投资基金，并相应修订基金合同部分条款。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具。主要包括国内依法发行上市的股票、债券、短期金融工具以及由中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华优质治理混合型证券投资基金（LOF）基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本报告期本基金没有发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开

营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
国信证券	503,960,147.33	11.57	43,679,771.90	1.18

6.4.8.1.2 债券交易

注：无。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
国信证券	-	-	72,400,000.00	3.02

6.4.8.1.4 权证交易

注：无。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国信证券	469,338.12	11.69	171,885.04	11.04
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国信证券	40,678.80	1.19	-	-

注：1、佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=买（卖）成交金额×1‰-买（卖）经手费-买（卖）证管费等由券商承担的费用

深圳证券交易所的交易佣金=买（卖）成交金额×1‰-买（卖）经手费-买（卖）证管费等由券商承担的费用

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

2、本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易单元租用协议》。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,653,564.86	7,045,570.45
其中：支付销售机构的客户维护费	1,308,221.75	1,376,728.03

注：1、支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为 1.50%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,108,927.43	1,174,261.74

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费年费率为 0.25%，逐日计提，按月支付。

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2007 年 4 月 25 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	35,184,805.00	35,184,805.00
报告期内申购/买入总份额	—	—
报告期内因拆分变动份额	—	—
减：报告期内赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	35,184,805.00	35,184,805.00
报告期末持有的基金份额	3.0108%	2.8688%

占基金总份 额比例		
--------------	--	--

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	102,671,745.75	459,511.46	43,993,945.34	572,405.11

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与本管理人、管理人控股股东、托管人、委托人及委托人控股股东承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2019 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：股)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 07 月 05 日	新股流通 受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	868,557,635.63	89.32
	其中：股票	868,557,635.63	89.32
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	103,134,550.93	10.61
8	其他各项资产	680,375.77	0.07
9	合计	972,372,562.33	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	34,694,550.00	3.58
B	采矿业	363,431.25	0.04
C	制造业	708,683,715.56	73.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,521,499.14	3.98
J	金融业	68,532,857.08	7.08

K	房地产业	17,738,476.00	1.83
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	868,557,635.63	89.74

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 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

金额单位：人民币元

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	000661	长春高新	243,317	82,241,146.00	8.50
2	000333	美的集团	1,112,418	57,689,997.48	5.96
3	002475	立讯精密	2,183,275	54,123,387.25	5.59
4	000858	五粮液	382,909	45,164,116.55	4.67
5	000063	中兴通讯	1,268,004	41,248,170.12	4.26
6	603517	绝味食品	963,120	37,474,999.20	3.87
7	601318	中国平安	418,800	37,109,868.00	3.83
8	000651	格力电器	674,700	37,108,500.00	3.83
9	000568	泸州老窖	434,400	35,112,552.00	3.63
10	300498	温氏股份	967,500	34,694,550.00	3.58

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站 <http://www.phfund.com.cn> 的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000661	长春高新	73,735,246.36	8.93
2	000063	中兴通讯	73,025,623.99	8.84
3	000333	美的集团	57,215,009.94	6.93
4	002475	立讯精密	51,038,043.81	6.18
5	600036	招商银行	47,156,566.06	5.71
6	000651	格力电器	47,007,150.42	5.69

7	601688	华泰证券	44,405,266.02	5.38
8	600030	中信证券	44,286,259.18	5.36
9	300498	温氏股份	38,906,195.00	4.71
10	000858	五 粮 液	37,785,602.75	4.58
11	601318	中国平安	36,902,513.00	4.47
12	002142	宁波银行	36,464,583.44	4.42
13	603517	绝味食品	36,141,208.70	4.38
14	002463	沪电股份	36,138,828.41	4.38
15	601336	新华保险	35,029,019.22	4.24
16	600837	海通证券	34,773,944.00	4.21
17	603338	浙江鼎力	34,567,250.87	4.19
18	300628	亿联网络	33,868,255.00	4.10
19	601166	兴业银行	31,890,272.29	3.86
20	300190	维尔利	30,185,696.07	3.65
21	300014	亿纬锂能	29,182,136.10	3.53
22	002353	杰瑞股份	29,098,200.81	3.52
23	601628	中国人寿	28,532,939.28	3.45
24	600519	贵州茅台	28,491,372.00	3.45
25	000568	泸州老窖	27,750,984.83	3.36
26	002121	科陆电子	27,736,126.06	3.36
27	002242	九阳股份	26,784,296.23	3.24
28	002027	分众传媒	26,313,657.00	3.19
29	002050	三花智控	26,100,863.60	3.16
30	600845	宝信软件	25,500,680.81	3.09
31	600068	葛洲坝	24,514,021.25	2.97
32	601009	南京银行	23,906,056.83	2.89
33	600143	金发科技	22,800,537.14	2.76
34	601186	中国铁建	22,678,588.42	2.75
35	002648	卫星石化	22,677,316.63	2.75
36	000596	古井贡酒	21,949,144.00	2.66
37	300454	深信服	21,760,702.71	2.63
38	002926	华西证券	21,722,804.00	2.63
39	600588	用友网络	20,420,705.01	2.47
40	300122	智飞生物	19,696,470.45	2.38
41	002798	帝欧家居	19,431,884.20	2.35
42	300760	迈瑞医疗	19,261,046.00	2.33
43	600276	恒瑞医药	19,138,741.87	2.32
44	600831	广电网络	19,113,386.51	2.31
45	002507	涪陵榨菜	18,892,142.22	2.29
46	603899	晨光文具	18,887,776.74	2.29
47	600583	海油工程	18,659,405.84	2.26
48	601998	中信银行	18,421,511.00	2.23

49	601225	陕西煤业	18,363,085.00	2.22
50	600016	民生银行	18,352,038.00	2.22
51	600340	华夏幸福	18,174,346.00	2.20
52	600585	海螺水泥	18,172,686.00	2.20
53	300124	汇川技术	17,541,908.10	2.12
54	600426	华鲁恒升	17,539,942.00	2.12
55	002350	北京科锐	17,430,208.49	2.11
56	000932	华菱钢铁	17,421,848.70	2.11
57	601377	兴业证券	17,027,080.26	2.06
58	600958	东方证券	17,025,657.91	2.06
59	600643	爱建集团	17,014,719.14	2.06

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000063	中兴通讯	68,475,319.25	8.29
2	600674	川投能源	62,340,166.37	7.55
3	600236	桂冠电力	62,255,546.32	7.54
4	600027	华电国际	54,222,115.81	6.57
5	600030	中信证券	50,164,160.58	6.07
6	600795	国电电力	47,171,386.92	5.71
7	601688	华泰证券	46,154,022.61	5.59
8	600886	国投电力	45,680,996.18	5.53
9	601991	大唐发电	45,069,509.87	5.46
10	601336	新华保险	42,611,047.76	5.16
11	000543	皖能电力	42,545,845.37	5.15
12	002616	长青集团	39,699,118.35	4.81
13	002142	宁波银行	39,569,196.71	4.79
14	600900	长江电力	39,120,854.37	4.74
15	600837	海通证券	38,424,069.70	4.65
16	002121	科陆电子	36,672,667.65	4.44
17	002353	杰瑞股份	35,702,724.64	4.32
18	601166	兴业银行	34,028,422.12	4.12
19	600011	华能国际	32,713,201.34	3.96
20	300190	维尔利	31,911,443.72	3.86
21	300454	深信服	31,726,955.49	3.84
22	000539	粤电力 A	31,336,916.51	3.79
23	002027	分众传媒	28,897,822.00	3.50
24	601766	中国中车	28,823,088.78	3.49
25	600406	国电南瑞	28,130,050.65	3.41
26	601628	中国人寿	27,900,323.88	3.38

27	002648	卫星石化	26,399,339.29	3.20
28	601009	南京银行	26,392,410.17	3.20
29	600143	金发科技	25,660,306.65	3.11
30	600068	葛洲坝	25,330,022.91	3.07
31	600831	广电网络	25,156,172.27	3.05
32	600323	瀚蓝环境	25,020,413.03	3.03
33	002242	九阳股份	23,648,688.61	2.86
34	601186	中国铁建	22,286,432.38	2.70
35	300170	汉得信息	22,149,105.67	2.68
36	603160	汇顶科技	21,709,920.57	2.63
37	600588	用友网络	20,808,959.31	2.52
38	601377	兴业证券	20,036,400.00	2.43
39	600277	亿利洁能	20,013,046.65	2.42
40	600958	东方证券	19,928,259.96	2.41
41	300124	汇川技术	19,804,557.17	2.40
42	002926	华西证券	19,562,304.90	2.37
43	600583	海油工程	19,285,349.49	2.34
44	600036	招商银行	19,264,502.16	2.33
45	600021	上海电力	19,219,656.06	2.33
46	600585	海螺水泥	18,837,973.25	2.28
47	600436	片仔癀	18,277,144.07	2.21
48	000852	石化机械	18,055,003.61	2.19
49	600426	华鲁恒升	18,011,838.28	2.18
50	600016	民生银行	17,925,679.00	2.17
51	600643	爱建集团	17,890,951.03	2.17
52	300747	锐科激光	17,843,680.65	2.16
53	002350	北京科锐	17,716,560.38	2.15
54	601225	陕西煤业	17,622,050.00	2.13
55	000932	华菱钢铁	17,304,180.00	2.10
56	600340	华夏幸福	17,042,250.17	2.06
57	601998	中信银行	16,720,746.00	2.02
58	300122	智飞生物	16,636,022.94	2.01
59	600570	恒生电子	16,613,307.72	2.01

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,183,171,862.92
卖出股票收入（成交）总额	2,175,293,817.98

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

7.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

注：无。

7.9 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

注：无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.12.2

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	602,171.50
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	19,814.91
5	应收申购款	58,389.36
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	680,375.77

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
69,779	16,747.19	55,609,882.65	4.76	1,112,992,148.62	95.24

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	鹏华基金管理有限公司	34,234,238.00	28.38
2	上海科技教育出版社	5,207,991.00	4.32
3	郑伟业	555,051.00	0.46
4	吴金荣	475,305.00	0.39
5	汪若清	421,231.00	0.35

6	冯铭	377,376.00	0.31
7	王艳	345,500.00	0.29
8	赵建新	295,300.00	0.24
9	李清娇	279,902.00	0.23
10	董玉坤	276,300.00	0.23

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截止本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007 年 4 月 25 日） 基金份额总额	1,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,208,924,849.98
本报告期基金总申购份额	6,080,609.77
减：本报告期基金总赎回份额	46,403,428.48
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,168,602,031.27

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	890,430,741.19	20.44%	814,977.09	20.30%	—
光大证券	1	838,425,766.06	19.25%	764,060.71	19.03%	—
申万宏源	2	772,091,161.09	17.72%	709,070.23	17.66%	—
中金公司	1	590,247,600.18	13.55%	549,694.70	13.69%	—
国信证券	1	503,960,147.33	11.57%	469,338.12	11.69%	—
华鑫证券	1	217,131,982.81	4.98%	202,212.50	5.04%	—
中信建投	1	161,261,804.80	3.70%	150,180.93	3.74%	—
湘财证券	1	113,767,582.74	2.61%	105,950.08	2.64%	—
招商证券	1	102,955,206.33	2.36%	95,881.75	2.39%	—
华西证券	1	75,426,971.46	1.73%	70,244.99	1.75%	—
长江证券	2	59,275,898.30	1.36%	55,204.78	1.37%	—
国金证券	1	31,584,906.58	0.72%	28,783.59	0.72%	—
东方证券	1	—	—	—	—	—
高华证券	1	—	—	—	—	—
广发证券	1	—	—	—	—	—
国泰君安	2	—	—	—	—	—

中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序

1、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- （1）实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- （2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- （3）经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- （4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- （5）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- （6）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2、选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性、及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	89,700,000.00	39.17%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

湘财证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	139,300,000.00	60.83%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注:无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

鹏华基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日