

# 鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资 基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	鹏华证券分级		
场内简称	券商指基		
基金主代码	160633		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 5 月 6 日		
基金管理人	鹏华基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	570,613,240.58 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	2015 年 5 月 12 日		
下属分级基金的基金简称	券商指基	券商 A 级	券商 B 级
下属分级基金的场内简称	券商指基	券商 A 级	券商 B 级
下属分级基金的交易代码	160633	150235	150236
报告期末下属分级基金的份额总额	508,152,846.58 份	31,230,197.00 份	31,230,197.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变

	通和调整,力求降低跟踪误差。本基金力争鹏华证券份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。		
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%		
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。		
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。	鹏华证券 A 份额为稳健收益类份额,具有低风险且预期收益相对较低的特征。	鹏华证券 B 份额为积极收益类份额,具有高风险且预期收益相对较高的特征。

注:无。

## 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	田青
	联系电话	0755-82825720	010-67595096
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	010-67595096
传真		0755-82021126	010-66275853

## 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	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
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	41,477,864.86
本期利润	154,494,641.88

加权平均基金份额本期利润	0.2648
本期基金份额净值增长率	36.42%
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	-1.5973
期末基金资产净值	543,290,006.15
期末基金份额净值	0.952

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。

(3)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

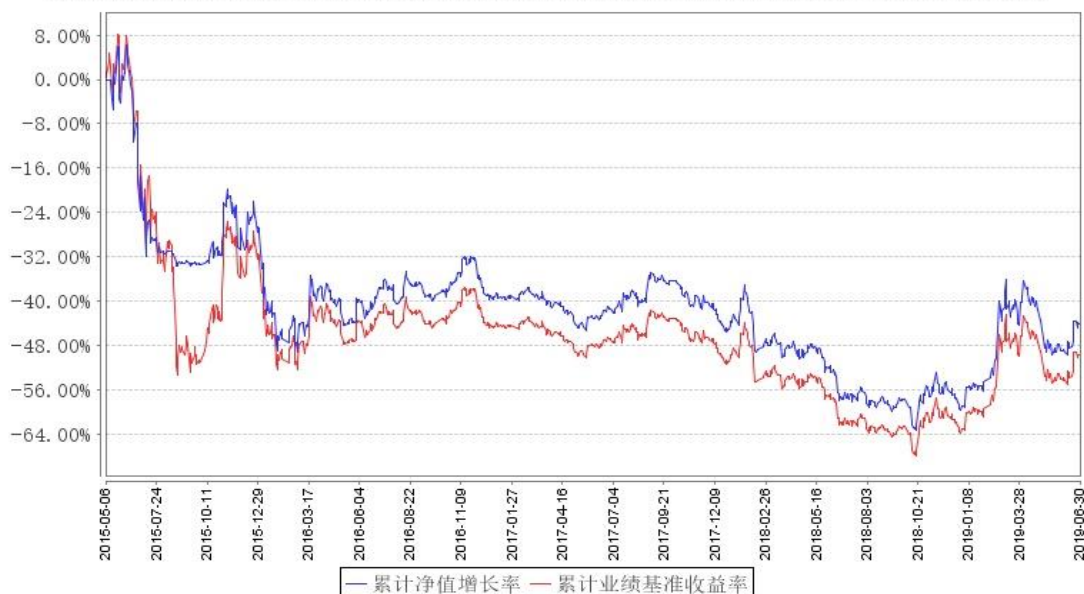
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	9.30%	1.95%	9.60%	1.98%	-0.30%	-0.03%
过去三个月	-6.58%	2.23%	-6.65%	2.25%	0.07%	-0.02%
过去六个月	36.42%	2.63%	36.51%	2.64%	-0.09%	-0.01%
过去一年	28.38%	2.28%	29.22%	2.31%	-0.84%	-0.03%
过去三年	-8.22%	1.66%	-11.49%	1.68%	3.27%	-0.02%
自基金成立起至今	-44.17%	2.01%	-49.79%	2.30%	5.62%	-0.29%

注:业绩比较基准=中证全指证券公司指数收益率\*95%+商业银行活期存款利率(税后)\*5%

### 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

鹏华证券分级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 2015 年 05 月 06 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		
余斌	本基金经理	2015-05-06	2019-03-19	12	余斌先生,国籍中国,经济学硕士,12

					<p>年证券投资基金从业经验。曾任职于招商证券股份有限公司,担任风险控制部市场风险分析师;2009年10月加盟鹏华基金管理有限公司,历任机构理财部大客户经理、量化投资部量化研究员,先后从事特定客户资产管理业务产品设计、量化研究等工作,现任量化投资部量化业务副总监、基金经理。2014年05月至2019年03月担任鹏华信息分级基金基金经理,2014年05月至2019年03月担任鹏华证券保险分级基金基金经理,2014年11月至2019年03月担任鹏华国防分级基金基金经理,2015年04月至2019年03月担任鹏华酒分级基金基金经理,2015年05月至2019年03月担任鹏华证券分级基金基金经理,2015年06月至2019年03月担任鹏华环保分级基金基金经理,2017年06月至2019年03月担任鹏华空天一体军工指数(LOF)基金基金经理,2017年06月至2019年03月担任鹏华量化策略混合基金基金经理,2018年04月至2019年04月担任鹏华地产</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>分级基金基金经理。余斌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,增聘陈龙为本基金基金经理,余斌不再担任本基金基金经理。</p>
陈龙	本 基 金 基 金 经 理	2019-03-19	-	10	<p>陈龙先生, 国籍中国, 经济学硕士, 10 年证券基金从业经验。曾任杭州衡泰软件公司金融工程师, 2009 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任监察稽核部金融工程总监助理、量化及衍生品投资部量化研究总监助理, 先后从事金融工程、量化研究等工作, 现任量化及衍生品投资部量化研究副总监、基金经理。2015 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华钢铁分级基金基金经理, 2016 年 07 月至 2018 年 04 月担任鹏华创业板分级基金基金经理, 2016 年 09 月至 2018 年 04 月担任鹏华地产分级基金基金经理, 2016 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华香港中小企业指数 (LOF) 基金基金经理, 2016 年 10 月至 2018 年 04 月担任鹏华互联网分级基金基金经理, 2019 年 03 月担任鹏华国防分级基金基金经理, 2019 年 03 月担任鹏</p>



					华空天一体军工指数（LOF）基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华证券分级基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华证券保险分级基金基金经理。陈龙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，增聘陈龙为本基金基金经理，余斌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

本基金秉承指数基金的投资策略，在应对基金申购赎回的基础上，力争跟踪指数的收益，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，上证指数上涨 19.45%，深证成指上涨 26.78%，本基金跟踪的证券公司指数上涨 38.44%。

报告期末，本基金份额净值为 0.9520 元，累计净值 0.5710 元。本报告期基金份额净值增长率为 36.42%，同期业绩比较基准收益率为 36.51%，基金年化跟踪误差为 1.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年上半年，A 股呈现普涨格局，主流宽基指数均获得较为可观的涨幅。沪深 300 指数上涨 27.07%，中证 500 指数上涨 18.77%，创业板指数上涨 20.87%。年初以来，受流动性宽松、信用环境修复、宏观经济改善以及中美贸易摩擦缓和等因素影响，股票市场也迎来较为快速的上涨。进入 4 月份，中央政治局会议定调政策转向，流动性宽松预期发生了变化，股市开始出现调整；而 5 月初，中美贸易摩擦再度升级，并升级为科技冷战，对 A 股市场带来较大的冲击，而 6 月份则再次出现缓和的迹象。

展望 2019 年下半年，宏观经济面临较大的下行压力，美国对中国出口商品加征关税的影响开始显现。从目前中美双方的表态来看，贸易谈判将确定性进入长期化的态势，并在中长期内影响全球和国内的产业格局。另一方面，今年财政、货币政策仍有对冲的空间，在海外环境没有进一步恶化的情况下，今年仍大概率能实现年初制定的经济增长目标。

具体到资本市场，我们倾向于认为下半年会呈现区间震荡的格局。一方面，考虑到高层对资本市场定位的表态，以及科创板的推出，资本市场出现系统性风险的概率不大；另一方面，上市公司基本面及产业资本减持的压力，使得市场趋势性上行的空间也会受到极大的压制。

从投资角度看，下半年可以关注两个方面的机会：1）因事件冲击造成市场恐慌性下跌带来的 Beta 机会；2）龙头股的 Alpha 机会，尤其需要重视消费龙头股及科技龙头股。虽然消费龙头目前估值处于历史高位，且持仓拥挤度较高，但其业绩仍具备较高的确定性，长期来看可以通过盈利的增长来消化当前的估值压力；而科技龙头将会显著受益于中美贸易冲突升级的背景下的自主可控战略，未来有望从事件和情绪驱动转向基本面驱动。

本基金将积极应对各种因素指数跟踪效果带来的冲击，本基金将积极应对各种因素指数跟踪效果带来的冲击，努力使得跟踪误差控制在基金合同规定的范围内，力争为投资者带来超越指数收益回报。

#### 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帐务处理；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

根据本基金基金合同约定，在存续期内，本基金（包括券商指基份额、券商 A 级份额、券商 B 级份额）不进行收益分配。

### 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核审查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。

# § 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：鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金

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
<b>资 产：</b>		
银行存款	33,831,447.78	22,953,917.78
结算备付金	1,663,131.05	1,669,612.52
存出保证金	209,554.78	139,103.01
交易性金融资产	513,902,121.91	393,872,834.46
其中：股票投资	513,902,121.91	393,872,834.46
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	—	3,626,142.93
应收利息	7,855.68	8,119.56
应收股利	—	—
应收申购款	1,515,592.02	203,001.03
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	551,129,703.22	422,472,731.29
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债:</b>		
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	670,240.57	-
应付赎回款	5,584,943.41	693,939.36
应付管理人报酬	510,591.87	391,795.90
应付托管费	112,330.21	86,195.11
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	561,116.86	422,678.37
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	400,474.15	401,547.97
负债合计	7,839,697.07	1,996,156.71
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	972,529,628.79	1,027,579,313.14
未分配利润	-429,239,622.64	-607,102,738.56
所有者权益合计	543,290,006.15	420,476,574.58
负债和所有者权益总计	551,129,703.22	422,472,731.29

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 570,613,240.58 份，其中券商指基基金份额总额为 508,152,846.58 份，基金份额净值 0.952 元；券商 A 级基金份额总额为 31,230,197.00 份，基金份额净值 1.014 元；券商 B 级基金份额总额为 31,230,197.00 份，基金份额净值 0.890 元。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金

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		159,725,540.96	-127,114,974.48
1. 利息收入		146,522.39	144,795.57
其中：存款利息收入		146,522.39	144,795.57
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		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		44,456,141.19	-98,313,135.40
其中：股票投资收益		43,748,458.97	-99,840,811.49
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		707,682.22	1,527,676.09
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		113,016,777.02	-29,758,699.11
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		2,106,100.36	812,064.46
减：二、费用		5,230,899.08	5,400,112.39
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	2,888,293.71	3,015,039.39
2. 托管费	6.4.8.2.2	635,424.61	663,308.72
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		1,468,951.09	1,399,544.79
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		238,229.67	322,219.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		154,494,641.88	-132,515,086.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		154,494,641.88	-132,515,086.87

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金

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）	1,027,579,313.14	-607,102,738.56	420,476,574.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期	-	154,494,641.88	154,494,641.88

利润)			
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)	-55,049,684.35	23,368,474.04	-31,681,210.31
其中: 1. 基金申购款	1,869,746,013.58	-808,226,817.26	1,061,519,196.32
2. 基金赎回款	-1,924,795,697.93	831,595,291.30	-1,093,200,406.63
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)	972,529,628.79	-429,239,622.64	543,290,006.15
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)	1,300,415,469.74	-587,570,293.64	712,845,176.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-132,515,086.87	-132,515,086.87
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)	-309,161,242.86	160,112,696.48	-149,048,546.38
其中: 1. 基金申购款	909,289,581.80	-409,598,479.98	499,691,101.82
2. 基金赎回款	-1,218,450,824.66	569,711,176.46	-648,739,648.20
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)	991,254,226.88	-559,972,684.03	431,281,542.85

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：

<u>邓召明</u>	<u>苏波</u>	<u>郝文高</u>
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

鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 505 号《关于准予鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金注册的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,030,703,657.95 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 428 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,030,790,724.11 份基金份额,其中认购资金利息折合 87,066.16 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》并报中国证监会备案,本基金的基金份额包括鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“鹏华证券份额”)、鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金之 A 份额(以下简称“鹏华证券 A 份额”)、鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金之 B 份额(以下简称“鹏华证券 B 份额”)。根据对基金财产及收益分配的不同安排,本基金的基金份额具有不同的风险收益特征。鹏华证券份额为可以申购、赎回但不能上市交易的基金份额,具有与标的指数相似的风险收益特征。鹏华证券 A 份额与鹏华证券 B 份额为可以上市交易但不能申购、赎回的基金份额,其中鹏华证券 A 份额为稳健收益类份额,具有低风险且预期收益相对较低的风险收益特征,鹏华证券 B 份额为积极收益类份额,具有高风险且预期收益相对较高的风险收益特征。鹏华证券 A 份额与鹏华证券 B 份额的配比始终保持 1:1 的比率不变。本基金的基金份额初始公开发售结束后,场外认购的全部份额将确认为鹏华证券份额;场内认购的份额将按照 1:1 的比例确认为鹏华证券 A 份额与鹏华证券 B 份额。本基金基金合同生效后,鹏华证券份额与鹏华证券 A 份额、鹏华证券 B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换,包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。基金份额的分拆,指基金份额持有人将其持有的鹏华证券份额按照 2 份场内鹏华证券份额对应 1 份鹏华证券 A 份额与 1 份



鹏华证券 B 份额的比例进行转换的行为；基金份额的合并，指基金份额持有人将其持有的鹏华证券 A 份额与鹏华证券 B 份额按照 1 份鹏华证券 A 份额与 1 份鹏华证券 B 份额对应 2 份场内鹏华证券份额的比例进行转换的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：鹏华证券份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为鹏华证券份额、鹏华证券 A 份额、鹏华证券 B 份额的份额数之和。鹏华证券 A 份额的基金份额净值为鹏华证券 A 份额的本金及约定应得收益之和。每 2 份鹏华证券份额所对应的基金资产净值等于 1 份鹏华证券 A 份额与 1 份鹏华证券 B 份额所对应的基金资产净值之和。

本基金定期进行份额折算。在鹏华证券 A 份额、鹏华证券份额存续期内的每个会计年度 11 月第一个工作日，本基金将进行基金的定期份额折算。在基金份额折算前与折算后，鹏华证券 A 份额与鹏华证券 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于鹏华证券 A 份额的约定应得收益，即鹏华证券 A 份额每个会计年度 10 月 31 日基金份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内鹏华证券份额分配给鹏华证券 A 份额持有人。鹏华证券份额持有人持有的每 2 份鹏华证券份额将按 1 份鹏华证券 A 份额获得新增鹏华证券份额的分配。持有场外鹏华证券份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外鹏华证券份额的分配；持有场内鹏华证券份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内鹏华证券份额的分配。经过上述份额折算，鹏华证券 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，鹏华证券份额的基金份额净值将相应调整。

除定期份额折算外，本基金还将在鹏华证券份额的基金份额净值达到 1.500 元时或鹏华证券 B 份额的基金份额参考净值跌至 0.250 元时进行不定期份额折算。当达到不定期折算条件时，本基金将分别对鹏华证券份额、鹏华证券 A 份额、鹏华证券 B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保鹏华证券 A 份额与鹏华证券 B 份额的比例为 1:1，份额折算后鹏华证券份额的基金份额净值、鹏华证券 A 份额与鹏华证券 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2015]第 188 号文审核同意，本基金鹏华证券 A 份额 336,303,495.00 份基金份额和鹏华证券 B 份额 336,303,496.00 份基金份额于 2015 年 5 月 15 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的鹏华证券份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为鹏华证券 A 份额和鹏华证券 B 份额即可上市流通；对于托管在场外的鹏华证券份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深交所场内后分拆为鹏华证券 A 份额和鹏华证券 B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股

及其备选成份股(含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票)、债券、股指期货、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于股票部分的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证全指证券公司指数收益率 $\times$ 95%+商业银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 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》、《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》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相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

无。

#### 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

中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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	190,276,559.24	19.63	320,731,915.37	36.20

##### 6.4.8.1.2 债券交易

注：无。

##### 6.4.8.1.3 债券回购交易

注：无。

##### 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	173,398.28	19.73	33,894.23	6.04
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	292,291.52	36.33	176,490.25	56.71

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 $\times$ 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 $\times$ 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	2,888,293.71	3,015,039.39
其中:支付销售机构的客户维护费	893,651.28	514,616.75

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 1.00%,逐日计提,按月支付。日管理费=前一日基金资产净值 $\times$ 1.00% $\div$ 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 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托管费	635,424.61	663,308.72

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费年费率为 0.22%,逐日计提,按月支付。日托管费=前一日基金资产净值 $\times$ 0.22% $\div$ 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**

注：无。

**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未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
中国建设银行	33,831,447.78	131,407.33	34,325,947.33	136,794.16

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

**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**

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有 1,107,060.00 股国信证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 12,745,610.07 元，估值总额为人民币 14,568,909.60 元，占基金资产净值的比例为 2.68%（2018 年 12 月 31 日：本基金持有 1,287,460 股国信证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 13,674,336.38 元，估值总额为人民币 10,776,040.20 元，占基金资产净值的比例为 2.56%）。

**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	2019 年 07 月 05	新股未上市	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

		日	日							
--	--	---	---	--	--	--	--	--	--	--

#### 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	513,902,121.91	93.25
	其中：股票	513,902,121.91	93.25
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	35,494,578.83	6.44
8	其他各项资产	1,733,002.48	0.31
9	合计	551,129,703.22	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	—	—

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	-	-
J	金融业	513,299,073.02	94.48
K	房地产业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	513,299,073.02	94.48

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	363,431.25	0.07
C	制造业	176,907.28	0.03
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	39,603.76	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-
S	综合	-	-
	合计	603,048.89	0.11

### 7.2.3 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股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资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	600030	中信证券	3,385,743	80,614,540.83	14.84
2	600837	海通证券	3,641,645	51,674,942.55	9.51
3	601211	国泰君安	2,029,468	37,240,737.80	6.85
4	601688	华泰证券	1,638,637	36,574,377.84	6.73
5	600999	招商证券	1,286,835	21,992,010.15	4.05
6	000166	申万宏源	4,056,706	20,324,097.06	3.74
7	000776	广发证券	1,331,907	18,300,402.18	3.37
8	600958	东方证券	1,610,990	17,205,373.20	3.17
9	002736	国信证券	1,107,060	14,568,909.60	2.68
10	601377	兴业证券	2,109,510	14,218,097.40	2.62

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。

#### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.07
2	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.01
3	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
4	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.01

5	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
6	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
7	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00

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	600030	中信证券	61,892,049.65	14.72
2	600837	海通证券	40,671,439.41	9.67
3	601688	华泰证券	32,437,602.20	7.71
4	601211	国泰君安	32,003,557.07	7.61
5	601099	太平洋	20,456,340.96	4.87
6	000166	申万宏源	18,747,033.36	4.46
7	600999	招商证券	18,576,513.60	4.42
8	000776	广发证券	17,472,504.20	4.16
9	601108	财通证券	15,827,785.90	3.76
10	600958	东方证券	15,568,042.00	3.70
11	601377	兴业证券	11,935,258.31	2.84
12	002736	国信证券	11,723,355.00	2.79
13	000750	国海证券	11,570,326.00	2.75
14	000783	长江证券	11,271,310.00	2.68
15	601901	方正证券	11,264,889.55	2.68
16	600061	国投资本	11,008,453.00	2.62
17	601555	东吴证券	9,455,016.90	2.25
18	601788	光大证券	9,221,866.54	2.19
19	600109	国金证券	9,128,279.09	2.17
20	000728	国元证券	7,384,620.50	1.76

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	600030	中信证券	79,221,608.33	18.84
2	600837	海通证券	49,858,539.76	11.86
3	601688	华泰证券	41,981,968.47	9.98
4	601211	国泰君安	37,605,778.66	8.94
5	600999	招商证券	21,847,150.32	5.20
6	000776	广发证券	19,713,620.00	4.69
7	600958	东方证券	18,144,841.04	4.32

8	000166	申万宏源	16,363,091.70	3.89
9	601377	兴业证券	14,276,119.09	3.40
10	002736	国信证券	13,958,081.58	3.32
11	601901	方正证券	13,639,552.31	3.24
12	000783	长江证券	13,037,648.98	3.10
13	601555	东吴证券	11,011,830.20	2.62
14	600109	国金证券	10,984,857.10	2.61
15	601099	太平洋	10,890,311.00	2.59
16	601788	光大证券	10,587,368.00	2.52
17	000728	国元证券	8,845,504.40	2.10
18	002673	西部证券	8,443,296.14	2.01
19	601198	东兴证券	7,864,379.02	1.87
20	600061	国投资本	6,853,301.33	1.63

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	467,258,897.87
卖出股票收入(成交)总额	503,994,846.41

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:无。

#### 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:无。

#### 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:无。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易

活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 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

广发证券 2018 年 9 月 5 日，广东证监局向广发信德智胜投资管理有限公司出具[2018]54 号《关于对广发信德智胜投资管理有限公司采取责令改正措施的决定》，指出信德智胜存在以下问题：1）部分基金产品在募集说明书或基金合同中约定预期收益率或业绩基准收益率，并按照约定的收益率向投资者支付收益；2）作为珠海广发信德新三板股权投资基金（有限合伙）和珠海广发信德厚维投资企业（有限合伙）的基金管理人，未采取问卷调查等方式对一名投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估；3）所管理的珠海横琴金投广发信德厚挚股权投资合伙企业（有限合伙）未对基金进行托管，且未在基金合同中明确保障私募财产安全的制度措施和纠纷解决机制，而对信德智胜采取责令改正的行政监管措施。对此，信德智胜管理层高度重视，立即组织了对相关问题的自查和整改，并形成报告及时完成向广东证监局的报备。2018 年 9 月 20 日，广东证监局向瑞元资本管理有限公司（以下简称“瑞元资本”）出具了《关于对瑞元资本管理有限公司采取责令改正措施的决定》（[2018]67 号），指出瑞元资本存在以下问题：1）公司部分专户产品自成立以来，瑞元资本作为管理人未编制并向资产委托人报送委托财产的投资报告；2）瑞元资本璟宸股权投资专项资产管理计划为高风险产品，其中一名资产委托人的风险承受能力测评结果为稳健型，瑞元资本未就该产品风险等级超越该委托人风险承受能力的情况要求委托人确认，而对瑞元资本采取责令改正的行政监管措施。瑞元资本管理层对广东证监局检查发现的问题高度重视，立即组织开展全面的业务自查，积极协调推进相关整改工作，形成整改报告并于近日完成向广东证监局的报备。2018 年 10 月 17 日，广东证监局向广发期货出具《关于对广发期货有限公司采取责令改正措施的决定》（[2018]77 号），指出广发期货资产管理业务存在第三方投顾或投资经理直接执行投资指令，未经交易员确认的问题，违反了《期货公司监督管理办法》第四十六条的规定。

对此，广发期货高度重视，由公司高管牵头，组织资产管理部员工对相关问题进行整改。2019 年 3 月 25 日，广发证券收到广东证监局《关于对广发证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（广东证监局行政监管措施决定书[2019]20 号），指出公司存在对境外子公司管控不到位，未有效督促境外子公司强化合规风险管理及审慎开展业务等问题，违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条、《证券公司和证券投资基金管理公司境外设立、收购、参股经营机构管理办法》第二十七条的规定；广东证监局依照《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，决定对公司采取责令改正的行政监管措施。对此，公司高度重视，将切实进行整改，采取措施建立并持续完善覆盖境外机构的合规管理、风险管理和内部控制体系。

对上述股票的投资决策程序的说明：本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数，控制跟踪误差，对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置，符合指数基金的管理规定，该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

东方证券 东方证券本次公告原因为控股子公司东方花旗证券有限公司在担任广东广州日报传媒股份有限公司（以下简称“粤传媒”）财务顾问期间涉嫌违反证券法律法规，中国证监会决定对其立案调查（详见公司 2018-053 号公告）。东方花旗以及郑剑辉、蔡军强收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2018]110 号），主要内容如下：东方花旗为粤传媒重大资产重组出具的财务顾问报告存在虚假记载。东方花旗作为粤传媒重大资产重组项目的独立财务顾问，在尽职调查过程中未勤勉尽责：未遵守尽职调查制度，未制定尽职调查清单和各主要阶段工作内容；未全面评估粤传媒并购重组活动所涉及的风险；未对上市公司并购重组活动进行充分、广泛、合理的调查，对香榭丽收入及应收账款核查程序缺失；内核机构未对应收账款问题进行核实，仅凭借项目组的回复即通过审核，内核程序流于形式。东方花旗的上述行为违反了《上市公司并购重组财务顾问业务管理办法》（证监会令第 54 号）（以下简称“《财务顾问管理办法》”）。根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据《证券法》第二百二十三条的规定，中国证监会决定：一、责令东方花旗改正，没收业务收入 595 万元，并处以 1785 万元罚款；二、对郑剑辉和蔡军强给予警告，并分别处以 10 万元罚款。

对上述股票的投资决策程序的说明：本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数，控制跟踪误差，对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置，符合指数基金的管理规定，该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

国信证券 2018 年 12 月 7 日，深交所出具《监管函》（深证函[2018]714 号），查明公司作为邹平电力购售电合同债权资产支持专项计划管理人，尽调过程中未勤勉尽责，出具资产支持专项计划说明书存在虚假记载，未及时监督、检查原始权益人持续经营情况和基础资产现金流情况，未及时就重大事项履行信息披露和报告义务。决定对公司采取书面警示的监管措施。

整改措施：公司根据深交所要求，出具专项整改报告，针对资产证券化业务开

展自查及整改活动，包括召开固定收益业务合规及风险控制专题会议；完善资产证券化业务内部管理组织架构；修改完善公司资产证券化业务内控制度；明确规范资产证券化尽调工作要求及程序；并加强存续期管理；将资产证券化业务纳入问核范围及现场核查范畴。2019 年 4 月 17 日，中国人民银行呼和浩特中心支行对公司内蒙古分公司作出《行政处罚决定书》（蒙银罚字[2019]第 4 号）。因内蒙古分公司未按规定有效履行反洗钱客户身份识别义务和未按照规定报送可疑交易报告，中国人民银行呼和浩特中心支行对内蒙古分公司及内蒙古分公司合规风控总监分别处以人民币 20 万元和 1 万元罚款。整改措施：内蒙古分公司和内蒙古分公司合规风控总监按时缴纳罚款，并及时完善内部反洗钱工作机制，加强了内部培训和审核机制，强化客户身份识别的审核效能，提高可疑交易报告工作质量。2019 年 2 月 18 日，香港证券及期货事务监察委员会对公司子公司国信香港的下属子公司国信证券（香港）经纪有限公司采取纪律行动，因国信证券（香港）经纪有限公司于 2014 年 11 月至 2015 年 12 月期间未遵守有关打击洗钱及恐怖分子资金筹集的监管规定，对其作出公开谴责及罚款 1,520 万港元。整改措施：国信证券（香港）经纪有限公司按时缴纳罚款，并主动聘请了外部反洗钱顾问对公司反洗钱管理体系进行了重新审视，从制度修订、流程建设、人员配备、系统采购、员工培训等方面进行了整改。对上述股票的投资决策程序的说明：本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数，控制跟踪误差，对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置，符合指数基金的管理规定，该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。招商证券 2019 年 5 月 29 日，公司披露《关于子公司被香港证监会采取纪律行动的公告》，内容如下：近日，香港证券及期货事务监察委员会（简称“香港证监会”）发布新闻稿，因本公司的全资子公司招商证券（香港）有限公司（以下简称“招证香港”）在担任中国金属再生资源（控股）有限公司上市申请的联席保荐人时（2008 年 11 月至 2009 年 6 月）没有履行其应尽的尽职审查责任，对招证香港采取纪律行动，包括处以罚款 2,700 万元港币。公司对以上决定无异议，并已采取措施，深化招证香港投行业务改革，强化勤勉、尽责、审慎、合规的原则，全面完善投行业务制度流程，提升投行业务内部控制水平，严控业务质量。预计上述事项不会对公司经营、财务状况及偿债能力造成重大影响，敬请广大投资者注意投资风险。2019 年 6 月 1 日，公司披露《关于子公司被香港证监会采取纪律行动的公告》，内容如下：近日，香港证券及期货事务监察委员会（简称“香港证监会”）发布新闻稿，因本公司的全资子公司招商证券（香港）有限公司（以下简称“招证香港”）错误处理客户款项（发生于 2011 年 10 月至 2014 年 9 月期间），香港证监会对招证香港采取纪律行动，包括处以罚款 500 万元港币。上述问题系因招证香港在程序及监控方面有所缺失，包括员工对于相关规则理解有偏差等所致，处理不当的客户款项均在日内转回客户账户，未造成客户损失。招证香港经自查发现问题，并主动报告香港

证监会。招证香港已于 2015 年委聘一家独立检讨机构完成了独立的合规及监控检讨，并及时进行内部回顾检讨，切实加强内部监控，保障客户利益。公司对以上决定无异议。上述事项预计不会对公司经营、财务状况及偿债能力造成重大影响，敬请广大投资者注意投资风险。对上述股票的投资决策程序的说明：本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数，控制跟踪误差，对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置，符合指数基金的管理规定，该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

## 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	209,554.78
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	7,855.68
5	应收申购款	1,515,592.02
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,733,002.48

## 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

### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

### 7.12.5.2 期末积极投资前五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

份额级别	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(%)
券商指基	36,343	13,982.14	351,586.72	0.07	507,801,259.86	99.93
券商A级	274	113,978.82	26,202,841.00	83.90	5,027,356.00	16.10
券商B级	6,033	5,176.56	1,113,234.00	3.56	30,116,963.00	96.44
合计	42,650	13,378.97	27,667,661.72	4.85	542,945,578.86	95.15

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

### 券商指基

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	何玄	586,416.00	3.69
2	张素珍	586,406.00	3.69
3	袁建新	408,133.00	2.57
4	王瑛	373,082.00	2.35
5	雷琰	299,872.00	1.89
6	黄红梅	242,926.00	1.53
7	武汉涌金科技投资管理有限公司	196,358.00	1.24
8	陈开容	185,566.00	1.17
9	张宇英	149,233.00	0.94
10	张利	140,142.00	0.88

### 券商A级

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	10,783,498.00	34.53
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	10,019,122.00	32.08
3	中国银河证券股份有限公司	2,314,809.00	7.41



4	百年人寿保险股份有限公司—万能保险产品	1,452,930.00	4.65
5	圆信永丰基金—兴业证券—圆信永丰丰享1号资产管理计划	875,376.00	2.80
6	吴捷云	477,379.00	1.53
7	陈恒	337,947.00	1.08
8	王少男	306,056.00	0.98
9	梁金锋	303,300.00	0.97
10	北京磐沣投资管理合伙企业（有限合伙）—磐沣价值私募证券投资基金	301,058.00	0.96

## 券商 B 级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	张良弟	2,657,939.00	8.51
2	史巍峰	916,000.00	2.93
3	李伶	629,875.00	2.02
4	袁建新	580,000.00	1.86
5	浙江巴克夏投资管理有限公司—巴克夏月月利1号	538,408.00	1.72
6	王志勇	448,681.00	1.44
7	方舟	400,917.00	1.28
8	李鲁同	370,300.00	1.19
9	雷琰	367,370.00	1.18
10	柴谦益	360,000.00	1.15

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

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	券商指基	48,698.27	0.0096
	券商 A 级	—	—
	券商 B 级	—	—
	合计	48,698.27	0.0085

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

## 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	券商指基	0~10
	券商 A 级	—
	券商 B 级	—
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	券商指基	—
	券商 A 级	—
	券商 B 级	—
	合计	—

注：1、截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

2、截至本报告期末，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

项目	券商指基	券商 A 级	券商 B 级
基金合同生效日（2015 年 5 月 6 日）基金份额总额	358,183,733.11	336,303,495.00	336,303,496.00
本报告期期初基金份额总额	368,376,016.72	27,837,166.00	27,837,166.00
本报告期基金总申购份额	979,094,047.28	—	—
减：本报告期基金总赎回份额	1,025,596,441.64	—	—
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	186,279,224.22	3,393,031.00	3,393,031.00
本报告期期末基金份额总额	508,152,846.58	31,230,197.00	31,230,197.00

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。拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算中调整的份额。

## § 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

基金管理人的重大人事变动：报告期内，基金管理人无重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 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	
长江证券	1	217,771,398.17	22.47%	198,460.51	22.58%	-
国信证券	2	190,276,559.24	19.63%	173,398.28	19.73%	-
天风证券	1	123,515,463.21	12.74%	112,559.12	12.81%	-
东方财富证券	2	79,699,201.83	8.22%	70,098.73	7.98%	本报告期

						新增 1 个
方正证券	2	76,925,491.33	7.94%	70,101.09	7.98%	-
广发证券	1	60,861,245.75	6.28%	55,462.51	6.31%	-
兴业证券	1	57,727,536.16	5.96%	52,606.92	5.99%	-
中金公司	2	57,084,414.92	5.89%	52,020.68	5.92%	-
中泰证券	2	40,477,998.72	4.18%	36,887.92	4.20%	-
中信证券	1	22,213,179.58	2.29%	20,242.92	2.30%	-
华融证券	1	16,964,858.33	1.75%	13,763.62	1.57%	-
华西证券	1	10,580,840.95	1.09%	9,642.22	1.10%	-
国金证券	1	4,150,414.06	0.43%	3,782.43	0.43%	-
平安证券	2	3,548,183.13	0.37%	3,233.41	0.37%	-
华创证券	1	3,349,964.00	0.35%	3,052.63	0.35%	-
中信建投	2	2,388,145.20	0.25%	2,176.18	0.25%	-
国联证券	1	1,812,937.67	0.19%	1,470.90	0.17%	本 报 告 期 新 增
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	本 报 告 期 新 增
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-

瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	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

注：无。

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20190513~20190617	—	177,456,231.37	177,456,231.37	—	—
	2	2019101~20190225	86,362,459.39	—	86,362,459.39	—	—
个人	—	—	—	—	—	—	—
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注:1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额、指数分级基金合并份额和红利再投；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额和指数分级基金

拆分份额。

#### 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