

# 鹏华新丝路指数分级证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	9
2.5 其他相关资料.....	9
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>10</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 其他指标.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	44
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.....	44
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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的情况.....	53
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>54</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	57

---

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>60</b>
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 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>61</b>
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华新丝路指数分级证券投资基金		
基金简称	鹏华新丝路分级		
场内简称	新丝路		
基金主代码	502026		
前端交易代码	-		
后端交易代码	-		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 8 月 13 日		
基金管理人	鹏华基金管理有限公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	13,950,254.04 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	2015 年 8 月 24 日		
下属分级基金的基金简称	新丝路	新丝路 A	新丝路 B
下属分级基金场内简称:	新丝路	新丝路 A	新丝路 B
下属分级基金的交易代码	502026	502027	502028
报告期末下属分级基金份额总额	7,069,316.04 份	3,440,469.00 份	3,440,469.00 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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>本基金力争鹏华新丝路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。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>(1) 股票投资组合的构建</p> <p>本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步</p>

买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

#### (2) 股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况，对其进行适时调整，以保证鹏华新丝路份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。

##### 1) 定期调整

根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

##### 2) 不定期调整

根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整；

根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金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。

#### 2、债券投资策略

本基金可以根据流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。

#### 3、衍生品投资策略

本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。

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，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水

	平，追求稳定的当期收益。 4、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。			
业绩比较基准	新丝路指数收益率×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	<table border="1"> <tr> <td>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。</td> <td>鹏华新丝路 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。</td> <td>鹏华新丝路 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。</td> </tr> </table>	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。	鹏华新丝路 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。	鹏华新丝路 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。
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。	鹏华新丝路 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。	鹏华新丝路 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。		

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	张燕
	联系电话	0755-82825720	0755-83199084
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006788999	95555
传真		0755-82021126	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层	深圳深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层	深圳深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		何如	李建红



## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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">http://www.phfund.com</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 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦招商银行股份有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-334,565.10
本期利润	-625,984.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0387
本期加权平均净值利润率	-4.54%
本期基金份额净值增长率	-8.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-2,427,717.07
期末可供分配基金份额利润	-0.1740
期末基金资产净值	11,121,386.77
期末基金份额净值	0.797
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-17.92%

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) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。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

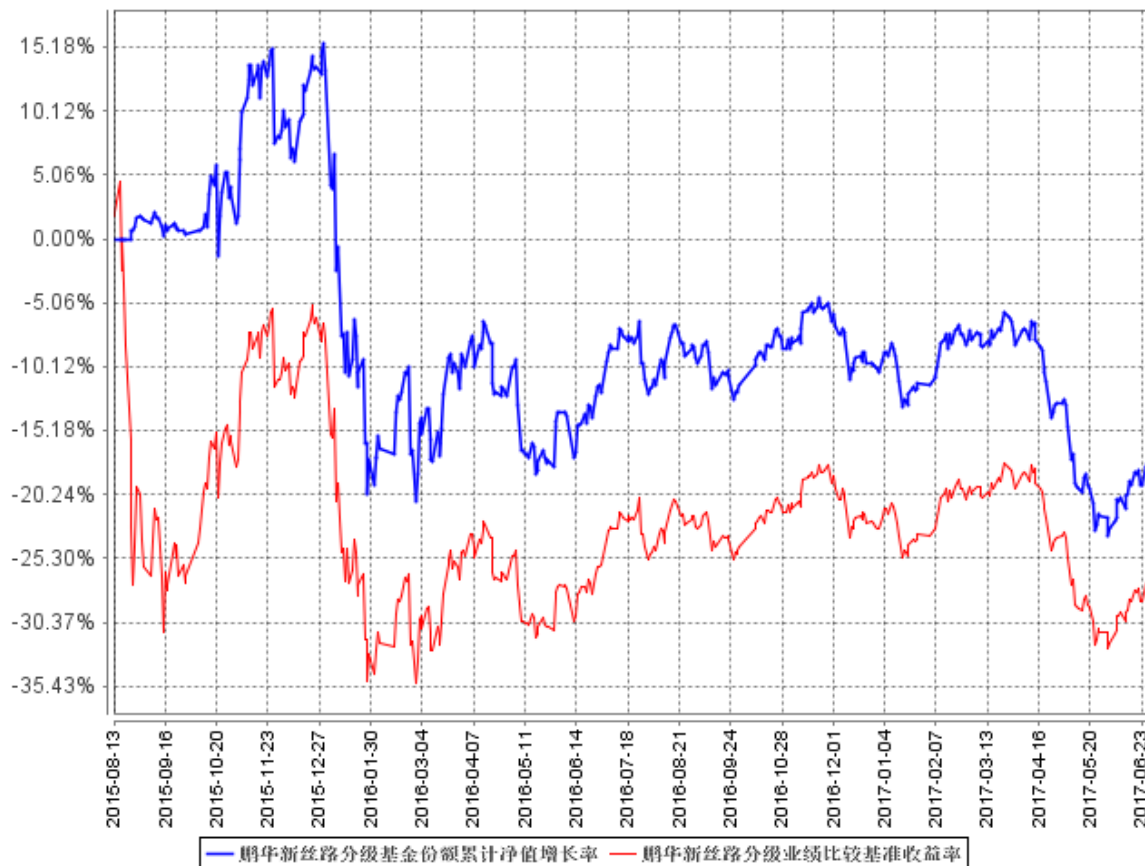
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.28%	0.95%	6.07%	0.93%	-0.79%	0.02%
过去三个月	-10.35%	1.14%	-8.87%	1.14%	-1.48%	0.00%
过去六个月	-8.29%	0.96%	-5.22%	0.98%	-3.07%	-0.02%
过去一年	-6.51%	0.94%	-1.44%	0.95%	-5.07%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-17.92%	1.59%	-26.93%	1.93%	9.01%	-0.34%

注：业绩比较基准=新丝路指数收益率\*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

鹏华新丝路分级基金份额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 8 月 13 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 2017 年 6 月，公司管理资产总规模达到 4509.30 亿元，管理 149 只公募基金、10 只全国社保投资组合、2 只基本养老保险投资组合。经过近 19 年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

#### 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		
张羽翔	本基金基金经理	2016 年 6 月 24 日	-	10	张羽翔先生，国籍中国，工学硕士，10 年金融证券从业经验。曾任招商银行软件中心（原深圳市融博技术公司）数据分析师；2011 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部资深金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员，先后从事金融工程、量化研究等工作；2015 年 9 月起担任鹏华上证民企 50ETF 基金及其联接基金基金经理，2016 年 6 月起兼任鹏华新丝路分级基金基金经理，2016 年 7 月起兼任鹏华高铁产业分级基金基金经理，2016 年 9 月起兼任鹏华中证 500 指数（LOF）、鹏华沪深 300 指数（LOF）基金经理，2016 年 11 月

					起兼任鹏华一带一路分级、鹏华新能源分级基金基金经理。张羽翔先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
--	--	--	--	--	--

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，在应对申购赎回的基础上，跟踪指数收益，力争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

截至本报告期末本基金份额净值为 0.7970 元；本报告期基金份额净值增长率为 -8.29%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年上半年, 上市公司整体盈利持续向好, 主板优势明显, 上中游业绩持续提升, 周期、消费强势不改, 其中煤炭、航运、水泥等二级行业业绩大幅提升。当前周期类板块受全球贸易和美国经济的回暖, 有望继续延续当前的经济增长活力。社会消费支出对于经济增长贡献明显, 位

列“三驾马车”之首，在资本市场上，业绩稳定的大消费股受到资金的追捧，尤其是上半年的家电、白酒板块，业绩争先爆发。

中国经济现正处在本轮库存周期、房地产周期和产能周期的末端，被动补库存、房地产调控、产能去化会给中国经济增长和结构调整带来压力。展望 2017 年下半年，受房地产周期下行和调控影响，房地产投资增速将下降，基础设施投资也会受到资金供给的影响。在出口和消费保持稳定增长的情况下，受投资增速回调的影响，中国经济增速将放缓，但全年实现 6.5% 的增长目标无忧。

下半年我们继续看好大盘蓝筹股持续表现和有确定业绩的新兴成长股的反弹。中长期看市场结构将进一步分化，缺乏内生增长支撑的高估值个股将面临估值回归，依赖内生增长、重视股东权益的上市公司将享受市场溢价和政策红利。

#### 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[2008]38号《关于进一步规范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、本公司现没有进行任何定价服务的签约。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

1. 根据本基金基金合同约定，在存续期内，本基金（包括新丝路份额、新丝路 A 份额、新丝路 B 份额）不进行收益分配。

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**

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元情形，本基金管理人及相关机构正在就可行的解决方案进行探讨论证。

## § 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，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：鹏华新丝路指数分级证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,049,306.93	1,429,644.16
结算备付金		12,919.20	-
存出保证金		4,162.51	33,357.54
交易性金融资产	6.4.7.2	10,593,909.92	18,566,686.73
其中：股票投资		10,593,909.92	18,566,686.73
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	267,352.14
应收利息	6.4.7.5	193.46	365.12
应收股利		-	-
应收申购款		20,375.06	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		11,680,867.08	20,297,405.69
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		126,033.80	28,042.68
应付赎回款		38,273.92	246,284.21
应付管理人报酬		9,079.19	20,181.92
应付托管费		1,997.42	4,440.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,115.95	16,008.55
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	380,980.03	425,782.24
负债合计		559,480.31	740,739.63
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	13,549,103.84	21,871,607.68
未分配利润	6.4.7.10	-2,427,717.07	-2,314,941.62
所有者权益合计		11,121,386.77	19,556,666.06
负债和所有者权益总计		11,680,867.08	20,297,405.69

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，新丝路份额净值 0.797 元，新丝路 A 份额净值 1.037 元，新丝路 B 份额净值 0.557 元；基金份额总额 13,950,254.04 份，其中新丝路份额 7,069,316.04 份，新丝路 A 份额 3,440,469.00 份，新丝路 B 份额 3,440,469.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华新丝路指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-213,646.30	-1,835,844.68
1.利息收入		4,745.51	12,248.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,745.51	12,248.21
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）		56,701.86	-604,370.72
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,181.97	-624,288.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	50,519.89	19,918.02
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-291,419.26	-1,365,939.75
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	16,325.59	122,217.58

<b>减：二、费用</b>		412,338.06	374,610.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	69,068.94	47,356.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	15,195.22	10,418.47
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	26,113.71	14,185.28
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	301,960.19	302,650.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-625,984.36	-2,210,455.63
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-625,984.36	-2,210,455.63

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华新丝路指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	21,871,607.68	-2,314,941.62	19,556,666.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-625,984.36	-625,984.36
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）	-8,322,503.84	513,208.91	-7,809,294.93
其中：1.基金申购款	6,341,179.60	-912,684.55	5,428,495.05
2.基金赎回款	-14,663,683.44	1,425,893.46	-13,237,789.98
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）	13,549,103.84	-2,427,717.07	11,121,386.77
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	8,878,361.96	1,183,182.87	10,061,544.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,210,455.63	-2,210,455.63
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）	-144,459.34	-35,045.65	-179,504.99
其中：1.基金申购款	111,027,291.29	-13,433,759.50	97,593,531.79
2.基金赎回款	-111,171,750.63	13,398,713.85	-97,773,036.78
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）	8,733,902.62	-1,062,318.41	7,671,584.21

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	_____ 高鹏	_____ 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

鹏华新丝路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]766号《关于准予鹏华新丝路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《鹏华新丝路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338,520,631.30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937号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》于2015年8月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为338,553,007.95份基金份额,其中认购资金利息折合32,376.65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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《鹏华新丝路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

额包括鹏华新丝路指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“鹏华新丝路份额”)、鹏华新丝路指数分级证券投资基金之 A 份额(以下简称“鹏华新丝路 A 份额”)、鹏华新丝路指数分级证券投资基金之 B 份额(以下简称“鹏华新丝路 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。鹏华新丝路份额为可以申购、赎回并且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。鹏华新丝路 A 份额与鹏华新丝路 B 份额为可以上市交易但不能申购、赎回的基金份额,其中鹏华新丝路 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,鹏华新丝路 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。鹏华新丝路 A 份额与鹏华新丝路 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新丝路份额;场内认购的份额将按照 2:4:4 的比例分别确认为场内鹏华新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额。本基金基金合同生效后,场内鹏华新丝路份额与鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 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场内鹏华新丝路份额按照 2 份场内鹏华新丝路份额对应 1 份鹏华新丝路 A 份额与 1 份鹏华新丝路 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新丝路 A 份额与鹏华新丝路 B 份额按照 1 份鹏华新丝路 A 份额与 1 份鹏华新丝路 B 份额对应 2 份场内鹏华新丝路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:鹏华新丝路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新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额的份额数之和。鹏华新丝路 A 份额的基金份额净值为鹏华新丝路 A 份额的本金及约定应得收益之和。每 2 份鹏华新丝路份额所对应的基金资产净值等于 1 份鹏华新丝路 A 份额与 1 份鹏华新丝路 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。在鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路份额存续期内的每个会计年度 9 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,鹏华新丝路 A 份额与鹏华新丝路 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于鹏华新丝路 A 份额的约定应得收益,即鹏华新丝路 A 份额每个会计年度 8 月最后一个自然日基金份额参考净值超出 1.000 元部分,将折算为场内鹏华新丝路份额分配给鹏华新丝路 A 份额持有人。鹏华新丝路份额持有人持有的每 2 份鹏华新丝路份额将按 1 份鹏华新丝路 A 份额获得新增鹏华新丝路份额的分配。持有场外鹏华新丝路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新丝路份额的分配;持有场内鹏华新丝路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新丝路份额的分配。经过上述份额折算,鹏华新丝路 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元,鹏华新丝路份额的基金

份额净值将相应调整。

除定期份额折算外，本基金还将在鹏华新丝路份额的基金份额净值达到 1.500 元时或鹏华新丝路 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新丝路份额、鹏华新丝路 A 份额、鹏华新丝路 B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保鹏华新丝路 A 份额与鹏华新丝路 B 份额的比例为 1:1，份额折算后鹏华新丝路份额的基金份额净值、鹏华新丝路 A 份额与鹏华新丝路 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2015]341 号文审核同意，本基金鹏华新丝路份额 20,537,936.00 份基金份额、鹏华新丝路 A 份额 41,075,869.00 份基金份额和鹏华新丝路 B 份额 41,075,869.00 份基金份额于 2015 年 8 月 24 日在上交所挂牌交易。未上市交易的份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下，可以通过跨系统转托管转至中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记结算系统持有人上海证券账户下后，在上海证券交易所上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金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%。本基金的业绩比较基准为：新丝路指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×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》、《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 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

本基金本报告期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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
活期存款	1,049,306.93
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,049,306.93

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	11,164,669.86	10,593,909.92	-570,759.94
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	11,164,669.86	10,593,909.92	-570,759.94

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。



**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	185.76
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5.80
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.90
合计	193.46

注：其他为应收结算保证金利息。

**6.4.7.6 其他资产**

注：无。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,115.95
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,115.95

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	144.24
预提费用	330,835.79
指数使用费	50,000.00
合计	380,980.03

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	22,517,193.31	21,871,607.68
本期申购	6,528,860.62	6,341,179.60
本期赎回(以“-”号填列)	-15,095,799.89	-14,663,683.44
本期末	13,950,254.04	13,549,103.84

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-572,692.82	-1,742,248.80	-2,314,941.62
本期利润	-334,565.10	-291,419.26	-625,984.36
本期基金份额交易产生的变动数	246,435.32	266,773.59	513,208.91
其中：基金申购款	-212,732.66	-699,951.89	-912,684.55
基金赎回款	459,167.98	966,725.48	1,425,893.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-660,822.60	-1,766,894.47	-2,427,717.07

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	4,522.53
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	59.72
其他	163.26
合计	4,745.51

注：其他为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	11,298,223.47
减：卖出股票成本总额	11,292,041.50
买卖股票差价收入	6,181.97

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：无。

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

#### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

#### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

#### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益**

注：无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	50,519.89
基金投资产生的股利收益	-
合计	50,519.89

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	-291,419.26
——股票投资	-291,419.26
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-291,419.26

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	16,243.79
转换费收入	81.80
合计	16,325.59

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	26,113.71
银行间市场交易费用	-
合计	26,113.71

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	148,767.52
上市年费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
银行汇划费用	1,124.40
合计	301,960.19

**6.4.7.21 分部报告**

无。

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

无。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 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。

**6.4.9.2 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	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

注：无。

**6.4.10.1.2 债券交易**

注：无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

注：无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

注：无。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	69,068.94	47,356.92
其中：支付销售机构的客户维护费	8,021.54	7,775.98

注：（1）支付基金管理人鹏华基金管理公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%÷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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,195.22	10,418.47

注：支付基金托管人招商银行股份有限公司的托管费年费率为 0.22%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.22%÷当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未投资、持有本基金。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016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
招商银行	1,049,306.93	4,522.53	756,512.88	12,039.22

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末未参与关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

注：无。

**6.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600545	新疆城建	2017年6月22日	重大事件	11.96	2017年7月3日	12.44	9,500	114,397.10	113,620.00	-
600165	新日恒力	2017年4月10日	重大事件	15.02	2017年7月20日	15.16	5,700	79,550.01	85,614.00	-
601069	西部黄金	2017年4月17日	重大事件	26.26	-	-	3,000	78,264.33	78,780.00	-
000610	西安旅游	2017年5月22日	重大事件	11.43	2017年7月24日	10.71	3,100	45,990.55	35,433.00	-
600706	曲江文旅	2017年6月19日	重大事件	19.88	2017年7月3日	21.87	1,600	30,025.35	31,808.00	-



### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在

银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2016 年 12 月 31 日：未持有）。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### **6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

无。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金及部分应收申购款，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,049,306.93	-	-	-	1,049,306.93
结算备付金	12,919.20	-	-	-	12,919.20
存出保证金	4,162.51	-	-	-	4,162.51
交易性金融资产	-	-	-	10,593,909.92	10,593,909.92
应收利息	-	-	-	193.46	193.46
应收申购款	-	-	-	20,375.06	20,375.06
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,066,388.64	-	-	10,614,478.44	11,680,867.08
负债					
应付证券清算款	-	-	-	126,033.80	126,033.80
应付赎回款	-	-	-	38,273.92	38,273.92
应付管理人报酬	-	-	-	9,079.19	9,079.19
应付托管费	-	-	-	1,997.42	1,997.42
应付交易费用	-	-	-	3,115.95	3,115.95
其他负债	-	-	-	380,980.03	380,980.03
负债总计	-	-	-	559,480.31	559,480.31
利率敏感度缺口	1,066,388.64	-	-	10,054,998.13	11,121,386.77
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,429,644.16	-	-	-	1,429,644.16
存出保证金	33,357.54	-	-	-	33,357.54
交易性金融资产	-	-	-	18,566,686.73	18,566,686.73
应收证券清算款	-	-	-	267,352.14	267,352.14
应收利息	-	-	-	365.12	365.12
资产总计	1,463,001.70	-	-	18,834,403.99	20,297,405.69
负债					
应付证券清算款	-	-	-	28,042.68	28,042.68
应付赎回款	-	-	-	246,284.21	246,284.21
应付管理人报酬	-	-	-	20,181.92	20,181.92

应付托管费	-	-	-	4,440.03	4,440.03
应付交易费用	-	-	-	16,008.55	16,008.55
其他负债	-	-	-	425,782.24	425,782.24
负债总计	-	-	-	740,739.63	740,739.63
利率敏感度缺口	1,463,001.70	-	-	18,093,664.36	19,556,666.06

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%。

（2016 年 12 月 31 日：未持有）因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响（2016 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2017 年 6 月 30 日		2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	10,593,909.92	95.26	18,566,686.73	94.94
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	10,593,909.92	95.26	18,566,686.73	94.94

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 ( 2017 年 6 月 30 日 )	上年度末 ( 2016 年 12 月 31 日 )
	业绩比较基准上升 5%	546,595.85	987,008.38
	业绩比较基准下降 5%	-546,595.85	-987,008.38

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定: (1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益), 不征收增值税; (2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期, 不属于金融商品转让; (3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外, 根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定, 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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 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	10,593,909.92	90.69
	其中：股票	10,593,909.92	90.69
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,062,226.13	9.09
7	其他各项资产	24,731.03	0.21
8	合计	11,680,867.08	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资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	241,167.20	2.17
B	采矿业	1,257,979.00	11.31
C	制造业	6,462,364.14	58.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	277,077.00	2.49
E	建筑业	257,946.80	2.32
F	批发和零售业	384,037.00	3.45
G	交通运输、仓储和邮政业	11,514.00	0.10
H	住宿和餐饮业	50,220.00	0.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	67,660.00	0.61
J	金融业	1,062,073.78	9.55
K	房地产业	160,228.00	1.44
L	租赁和商务服务业	251,994.00	2.27
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	67,241.00	0.60
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	42,408.00	0.38
S	综合	-	-
	合计	10,593,909.92	95.26

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 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所有股票投资明细

### 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所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	600089	特变电工	55,888	577,323.04	5.19
2	000166	申万宏源	90,260	505,456.00	4.54
3	002673	西部证券	32,599	463,557.78	4.17
4	002202	金风科技	28,000	433,160.00	3.89
5	000768	中航飞机	22,500	414,900.00	3.73
6	600893	航发动力	13,700	374,010.00	3.36
7	601012	隆基股份	21,100	360,810.00	3.24
8	600516	方大炭素	18,600	264,492.00	2.38
9	601225	陕西煤业	35,400	250,278.00	2.25
10	601168	西部矿业	32,100	246,849.00	2.22
11	002092	中泰化学	18,500	234,950.00	2.11
12	600256	广汇能源	54,900	227,286.00	2.04
13	002185	华天科技	28,840	208,801.60	1.88
14	000415	渤海金控	30,600	205,938.00	1.85
15	601179	中国西电	32,400	180,144.00	1.62
16	300159	新研股份	13,600	180,064.00	1.62
17	600737	中粮糖业	18,700	176,528.00	1.59
18	000792	盐湖股份	16,000	167,200.00	1.50
19	000697	炼石有色	7,900	161,713.00	1.45
20	000981	银亿股份	16,400	160,228.00	1.44
21	600307	酒钢宏兴	53,100	151,335.00	1.36
22	000516	国际医学	26,550	147,883.50	1.33



23	002302	西部建设	6,600	146,322.00	1.32
24	600771	广誉远	3,600	143,820.00	1.29
25	000877	天山股份	10,700	135,569.00	1.22
26	600343	航天动力	6,900	119,646.00	1.08
27	600108	亚盛集团	27,550	118,740.50	1.07
28	600545	新疆城建	9,500	113,620.00	1.02
29	600687	刚泰控股	8,800	113,344.00	1.02
30	601958	金钼股份	15,700	112,569.00	1.01
31	002145	中核钛白	17,000	103,360.00	0.93
32	002307	北新路桥	5,600	101,080.00	0.91
33	300116	坚瑞沃能	9,400	101,050.00	0.91
34	000563	陕国投 A	18,000	93,060.00	0.84
35	600165	新日恒力	5,700	85,614.00	0.77
36	600720	祁连山	10,900	85,347.00	0.77
37	600337	美克家居	14,890	84,128.50	0.76
38	000552	靖远煤电	22,900	81,753.00	0.74
39	600509	天富能源	10,700	81,427.00	0.73
40	600084	中葡股份	10,800	80,244.00	0.72
41	600197	伊力特	4,100	80,073.00	0.72
42	601069	西部黄金	3,000	78,780.00	0.71
43	600707	彩虹股份	9,800	77,616.00	0.70
44	002457	青龙管业	4,200	74,760.00	0.67
45	601369	陕鼓动力	11,000	72,820.00	0.65
46	002267	陕天然气	8,200	72,078.00	0.65
47	600251	冠农股份	8,700	69,339.00	0.62
48	002100	天康生物	8,500	68,255.00	0.61
49	600831	广电网络	6,800	67,660.00	0.61
50	600869	智慧能源	9,200	61,916.00	0.56
51	002524	光正集团	6,400	59,264.00	0.53
52	000815	美利云	4,500	58,590.00	0.53
53	600075	新疆天业	6,520	56,854.40	0.51
54	000812	陕西金叶	6,600	56,232.00	0.51
55	603169	兰石重装	4,500	54,675.00	0.49
56	000561	烽火电子	5,000	50,650.00	0.46
57	000721	西安饮食	6,200	50,220.00	0.45
58	300021	大禹节水	6,100	50,081.00	0.45
59	600354	敦煌种业	6,600	49,434.00	0.44
60	600888	新疆众和	7,930	49,007.40	0.44
61	000635	英力特	2,800	47,460.00	0.43

62	000813	德展健康	5,450	47,033.50	0.42
63	300140	中环装备	2,600	46,540.00	0.42
64	000796	凯撒旅游	3,800	46,056.00	0.41
65	600090	同济堂	4,900	45,913.00	0.41
66	600449	宁夏建材	4,700	45,167.00	0.41
67	600419	天润乳业	900	45,117.00	0.41
68	603227	雪峰科技	6,700	44,957.00	0.40
69	000564	供销大集	6,800	44,268.00	0.40
70	000159	国际实业	6,400	43,584.00	0.39
71	600192	长城电工	5,500	42,515.00	0.38
72	000672	上峰水泥	4,700	42,488.00	0.38
73	603999	读者传媒	1,900	42,408.00	0.38
74	002772	众兴菌业	3,026	40,699.70	0.37
75	300084	海默科技	4,300	39,646.00	0.36
76	300114	中航电测	2,800	37,744.00	0.34
77	002149	西部材料	3,300	37,686.00	0.34
78	300164	通源石油	5,300	36,305.00	0.33
79	002644	佛慈制药	3,900	36,270.00	0.33
80	601015	陕西黑猫	4,700	35,720.00	0.32
81	000610	西安旅游	3,100	35,433.00	0.32
82	600543	莫高股份	2,900	35,206.00	0.32
83	002700	新疆浩源	3,100	33,232.00	0.30
84	600359	新农开发	4,300	32,293.00	0.29
85	603919	金徽酒	1,690	32,245.20	0.29
86	600217	中再资环	5,000	31,900.00	0.29
87	600706	曲江文旅	1,600	31,808.00	0.29
88	000606	神州易桥	3,000	30,570.00	0.27
89	300103	达刚路机	1,600	30,560.00	0.27
90	600248	延长化建	5,060	30,511.80	0.27
91	600984	建设机械	3,200	24,192.00	0.22
92	002719	麦趣尔	700	23,709.00	0.21
93	600714	金瑞矿业	1,900	22,800.00	0.21
94	000791	甘肃电投	2,200	19,250.00	0.17
95	603101	汇嘉时代	1,100	18,260.00	0.16
96	603843	正平股份	900	12,735.00	0.11
97	002799	环球印务	600	11,940.00	0.11
98	603393	新天然气	300	11,826.00	0.11
99	002800	天顺股份	300	11,514.00	0.10
100	300534	陇神戎发	600	11,322.00	0.10

101	000617	中油资本	200	3,120.00	0.03
-----	--------	------	-----	----------	------

### 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所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 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	002673	西部证券	293,488.92	1.50
2	600089	特变电工	203,977.96	1.04
3	000166	申万宏源	196,501.00	1.00
4	000768	中航飞机	166,038.00	0.85
5	600687	刚泰控股	155,063.02	0.79
6	300159	新研股份	138,373.00	0.71
7	002202	金风科技	138,249.00	0.71
8	600893	航发动力	134,581.00	0.69
9	601012	隆基股份	116,895.00	0.60
10	002185	华天科技	93,484.00	0.48
11	600256	广汇能源	82,952.00	0.42
12	601225	陕西煤业	66,669.00	0.34
13	601179	中国西电	60,755.00	0.31
14	600516	方大炭素	58,955.00	0.30
15	000415	渤海金控	53,678.00	0.27
16	002302	西部建设	52,306.00	0.27
17	002772	众兴菌业	52,275.00	0.27
18	600737	中粮糖业	51,985.00	0.27
19	000792	盐湖股份	48,847.00	0.25
20	002092	中泰化学	48,040.00	0.25

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	600893	航发动力	621,795.00	3.18

2	000166	申万宏源	570,820.00	2.92
3	600089	特变电工	490,472.00	2.51
4	002202	金风科技	465,092.00	2.38
5	000768	中航飞机	464,605.66	2.38
6	002673	西部证券	464,605.00	2.38
7	601012	隆基股份	325,903.00	1.67
8	600256	广汇能源	258,661.00	1.32
9	601168	西部矿业	225,986.00	1.16
10	000563	陕国投A	219,964.00	1.12
11	600737	中粮糖业	211,908.57	1.08
12	002092	中泰化学	210,228.00	1.07
13	000415	渤海金控	209,054.00	1.07
14	601179	中国西电	194,581.00	0.99
15	000792	盐湖股份	194,337.00	0.99
16	601225	陕西煤业	184,493.00	0.94
17	600516	方大炭素	178,038.00	0.91
18	000697	炼石有色	172,423.00	0.88
19	300159	新研股份	171,701.00	0.88
20	600307	酒钢宏兴	163,051.00	0.83

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	3,610,683.95
卖出股票收入（成交）总额	11,298,223.47

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所有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：本基金本报告期内未发生股指期货投资。

### 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，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。

## 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

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

本组合投资的前十名证券之一西部证券股份有限公司

关于最近五年被证券监管部门和交易所采取监管措施或处罚的情况以及相应整改措施的公告 本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。西部证券股份有限公司（以下简称“西部证券”或“公司”）向原股东配售股份（以下简称“配股”）已经公司第四届董事会第十三次会议和 2015 年度股东大会审议通过，按照相关监管要求，现将公司最近五年被证券监管部门和交易所采取监管措施或处罚及相应整改情况公告如下：

一、2013 年 8 月 9 日，中国证监会北京监管局下发[2013]9 号行政监管措施决定书

（一）具体情况 公司于 2013 年 8 月 9 日收到了中国证监会北京监管局下发的[2013]9 号行政监管措施决定书《关于对西部证券股份有限公司北京德胜门外大街证券营业部采取出具警

示函措施的决定》。其主要内容为：“经查，我局发现你营业部存在以下违规行为：一是营业部总经理持续缺位未按规定报备。二是内部管理混乱。三是投资者适当性管理机制不健全。上述行为违反了《证券公司分支机构监管规定》（中国证监会公告〔2013〕17号）第十七条第二款等相关规定。根据《证券公司分支机构监管规定》（中国证监会公告〔2013〕17号）第二十条之规定，我局决定对你营业部采取出具警示函的行政监管措施。”

（二）整改情况 收到警示函之后，公司高度重视，立即召开紧急会议，并在公司进行了通报，要求全公司以此为戒，严格按照法律法规、公司章程及各项制度的规定，加强合规经营，充分认识信息披露的重要性。安排专项小组到营业部协助整改，作出以下整改措施：1、经与北京监管局机构二处充分沟通后，免去盘金顺同志营业部总经理的职务，并任命尹学强同志为西部证券北京德外大街证券营业部总经理，并以书面形式向北京监管局报备，并在北京证券业协会网站对营业部负责人进行了登记更新。2、在公司总部专项小组的帮助下，营业部对公司现有的合规、内控及业务制度进行了全面梳理，将营业部的制度与公司总部逐一比对，完善了不足之处，并修订了关于投诉回访部分的相关细则；安排专人负责，完成五个机构客户组织机构代码证的更新工作，四户办理了销户手续；联系对应的银行和客户，补齐银行章；营业部已加强该岗位的岗前培训和再教育，以确保认真、及时地完成回访工作，公司每季度要求营业部报送完整的回访记录，以此保证监督回访工作的顺利完成；及时制定了《信息技术关联单位联系制度》。3、在公司总部专项小组的帮助下，营业部对公司现行的《经纪业务客户适当性管理办法》进行了整理，对经纪业务客户适当性管理的分类原则、客户特征及行为分析、客户分类标准与适配产品及客户适当性管理要求进行了详细规定，并规定公司客户风险等级评测工作至少两年进行一次后续评估；修订了营业部的信访应急处理预案，妥善解决信访及投诉问题。2013年12月，公司北京德外大街证券营业部向中国证监会北京监管局提交了《西部证券股份有限公司北京德外大街证券营业部关于〈中国证券监督管理委员会北京监管局行政监管措施决定书〉事项的整改报告》。

二、2016年8月2日，中国证监会湖北监管局下发[2016]9号行政监管措施决定书

（一）具体情况 公司于2016年8月2日收到了中国证监会湖北监管局下发的[2016]9号行政监管措施决定书《关于对西部证券股份有限公司湖北分公司采取责令增加内部合规检查次数的监管措施的决定》。其主要内容为：“经查，你分公司防范和控制风险的内部控制制度在运行中存在缺陷，规范负责人行为的监督机制不够完善。上述行为违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条关于“证券公司应当按照审慎经营的原则，建立健全风险管理与内部控制制度，防范和控制风险”的规定。按照《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，我局决定：责令你公司在2016年8月1日至2017年7月31日期间，每3个月开展一次内部合规检查，并在每次检查后

10 个工作日内，向我局报送合规检查报告。”

(二) 整改情况 收到《决定》之后，公司高度重视，进行深刻的反思和总结，举一反三，组织合规总监、首席风险官以及相关部门，全面梳理风险隐患，认真研究和严格落实《决定》要求，并进一步提出以下整改措施：1、强化分公司内部控制和风险防范工作 (1) 建立健全员工道德风险防范制度。2016 年 6 月 13 日，公司制定并下发了《西部证券股份有限公司员工道德风险管理规定（暂行）》，从新员工选聘、入职审批管理、岗位聘用、道德和法制教育培训、试用期和绩效考核管理、监督举报渠道和信息反馈等多个方面强化内部监督管理。同时，加强和细化了员工（尤其是中层以上管理岗位和关键岗位）的道德风险监督措施。当前，由公司监察部门统筹员工道德风险防范工作，组织人力资源部、企业文化部等相关部门严格落实制度要求。(2) 有序开展公司监察巡查工作。公司监察部门牵头建立公司监察巡查工作机制，运营管理总部负责组织对公司经纪业务体系分支机构的巡查工作，及时向监察部门报告巡回检查情况。当前公司业务部门已成立经验丰富的巡回检查组，进一步完善巡回检查的计划、内容及方式，每年按工作计划和目标对全国经纪业务分支机构合规运营情况（重点是分支机构负责人履职情况）开展巡回检查工作。2、完善公司各级管理人员的人事考察和管理 (1) 公司人力资源部加快落实了人事考察任命的风险排查工作。公司人力资源部对近三年以来的人事考察任命工作进行了风险排查，对于分支机构负责人的任命，公司按照《证券公司董事、监事和高级管理人员任职资格监管办法》等监管规定，严格审查任职资格，向监管机构履行任职资格申报或者任职后报备手续。其中，在人事考察环节将拟任人选的道德品质和诚信表现列为首要考察内容，并把廉政意见、个人信用报告、工作鉴定等列为人事考察的必备文件。(2) 完善公司各级管理人员的人事考察和管理工作。公司人力资源部加强了各级管理人员甄选工作，通过背景调查、人员访谈等方式，结合廉政意见、人民银行征信系统的个人信用报告、原单位工作鉴定等书面文件，对拟任人选进行多角度的道德层面和守法情况的考察了解；针对管理人员设定任职试用期。公司合规与法律事务部在拟聘各级管理人员人事考察环节增加了针对性的法律法规及准则的学习和合规考试环节，考试结果可作为公司人事聘用决策的重要参考；实际工作中，公司还将持续加强道德风险、守法合规教育课程的开发和培训，从源头防范管理人员道德风险。目前，公司已向中国证监会湖北监管局提交了《西部证券股份有限公司湖北分公司关于被采取行政监管措施的整改报告》。公司将严格按照《决定》要求，自 2016 年 8 月 1 日至 2017 年 7 月 31 日期间，每 3 个月开展一次内部合规检查，并在每次检查后 10 个工作日内形成合规检查报告报送湖北监管局。

三、2016 年 8 月 30 日，中国证监会陕西监管局下发[2016]8 号行政监管措施决定书

(一) 具体情况 公司于 2016 年 8 月 30 日收到了中国证监会陕西监管局下发的[2016]8

号行政监管措施决定书《关于对西部证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定》。其主要内容为：“经查，你公司在担任宝信国际融资租赁有限公司（以下简称“宝信租赁”）于 2015 年 7 月 7 日公开发行的公司债券（以下简称“15 宝信债”）受托管理机构过程中，存在以下问题：2015 年 1 月至 9 月，宝信租赁累计新增借款 16.18 亿元，超过 2014 年期末净资产 6.11 亿元的 20%，但宝信租赁未按照《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第 113 号）第四十五条第（五）项规定及时对此进行信息披露。作为“15 宝信债”受托管理机构，你公司未能在债券存续期内持续有效督导宝信租赁履行信息披露义务。上述行为违反了《公司债券发行与交易管理办法》第五十条第（四）项的规定。根据《公司债券发行与交易管理办法》第五十八条，我局决定对你公司采取出具警示函的监督管理措施。请你公司加强公司债券持续督导工作，完善受托管理人履职机制，杜绝此类事件再次发生。

（二）整改情况 收到《决定》之后，公司高度重视，安排业务部门对相关项目情况进行认真核查，同时组织项目组人员认真学习《公司债券发行与交易管理办法》等相关的法律、法规、部门规章，就存在的问题进行研究讨论，仔细查找和分析问题原因，认真研究和严格落实《决定》要求，并进一步提出以下整改措施：1、成立专项小组，做好问题整改和持续督导工作 公司安排由固定收益部成立专项小组，成员包括固定收益部总经理、“15 宝信债”项目组负责人和经办人员、合规风控专员，具体负责“15 宝信债”问题核查、整改和监督工作。专项小组通过查阅受托管理工作底稿、受托管理事务报告和其他披露的文件、访谈受托管理工作经办人员等方式对“15 宝信债”项目组受托管理工作开展情况、与监管机构和发行人的沟通情况、发行人收到监管措施后的整改措施及我司履职情况等方面进行了排查。“15 宝信债”项目组认真总结受托管理工作中容易忽视的环节，举一反三，持续做好“15 宝信债”后期的受托管理工作；相关业务部门提高对债券受托管理工作的重视程度，领会监管机构从严监管的精神，提高与发行人沟通效率，及时做好信息披露工作并督促发行人履行信息披露义务；加强与监管机构沟通，进一步了解和学习对于公司债券发行人新增借款计算口径的最新标准和要求。公司按照《西部证券股份有限公司合规问责办法》启动合规问责程序，结合“15 宝信债”受托管理工作中业务部门和人员的履职情况对相关人员进行合规问责。2、组织学习监管文件，提高业务人员专业素质 公司前期已结合监管要求和业务需要，对公司债券业务制度体系进行了完善，于 2016 年 6 月印发了《西部证券股份有限公司公司债券受托管理制度》、《西部证券股份有限公司固定收益承销项目持续督导及重大风险事项处置预案管理办法》等多个公司债券受托管理工作相关制度。公司已要求相关业务部门和人员加强对《公司债券发行与交易管理办法》、《公司债券受托管理人执业行为准则》等监管文件和公司相关制度的学习，及时了解、掌握监管机构和公司内部对于公司债券受托管理工作的最新要求，



提高业务人员的专业素质和合规意识。3、全面加强公司债券受托管理工作管理 公司要求相关业务部门加强对监管要求和公司制度的执行力度。项目组应严格按照监管要求、公司制度规定和受托管理协议的约定，勤勉尽责，做好对发行人和增信机构资信状况的持续跟踪，关注担保物及其他增信机制、偿债保障措施的变化情况。定期对公司债券募集资金的接收、存储、划转与本息兑付情况进行监督，定期检查使用情况是否与募集说明书约定相一致。持续督导发行人履行信息披露义务及重大事项报告义务，及时披露定期受托管理事务报告、临时受托管理事务报告、中国证监会及自律组织要求披露的其他文件，做好受托管理工作的记录留痕等工作。受托管理工作中需对外披露的文件，还要求上报公司投资银行业务质量控制及内部审核办公室（以下简称“质控办”）进行审核把关。公司要求相关业务部门定期向风险管理部、合规与法律事务部填报《债券运行情况表》，及时报告已发行公司债券的存续期状况。若公司债券发生兑付风险等重大情况时，应作为重大事项及时上报公司。公司将加大对公司债券受托管理工作的检查力度，合规与法律事务部、质控办等监督检查部门将不定期组织业务部门对由我司担任受托管理人的公司债券项目开展自查工作并进行现场检查。公司已向中国证监会陕西监管局提交了《西部证券股份有限公司关于被采取行政监管措施的整改报告》。公司将严格按照《决定》要求，加强公司债券持续督导工作，完善受托管理人履职机制，杜绝此类事件再次发生。对于最近五年被监管部门采取监管措施的事项，公司均按照监管要求进行了相应整改，完善了内部控制制度，落实了风险合规管理的长效机制。

除上述情况外，公司最近五年不存在被其他证券监管部门和交易所采取监管措施或处罚的情形。在未来日常经营中，公司将在证券监督管理部门、深圳证券交易所和行业自律性组织的监管和指导下，继续完善公司法人治理机制，加强规范运作，进一步健全和完善全面风险管理体系，促进公司健康持续发展。特此公告。

西部证券股份有限公司（以下简称“公司”）收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）行政监管措施决定书《关于对西部证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2017]6号），原文如下：“经查，我会发现你公司个别营业部利用同名微信公众号向不特定对象公开宣传推介私募资产管理产品。上述行为违反了《证券公司客户资产管理业务管理办法》第三十九条、《私募投资基金监督管理暂行办法》第十四条、《证券公司监督管理条例》第二十七条的规定。按照《私募投资基金监督管理暂行办法》第三十三条、《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，我会决定对你公司采取责令改正的行政监督管理措施。你公司应按照相关法律、行政法规和中国证监会规定的要求落实整改，进一步梳理相关流程，强化有关人员守法合规意识。我会在日常监管中持续关注并检查你公司的整改情况。如果对本监督管理措施不服，可以在收到

本决定书之日起 60 日内向我会提出行政复议申请,也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间,上述监督管理措施不停止执行。我公司将按照相关法律、行政法规和中国证监会规定的要求落实整改,进一步梳理相关流程,强化有关人员守法合规意识,在今后的工作中防止此类情况的再次发生。以上行政监管措施对公司业绩暂无重大不利影响,公司目前经营情况正常,敬请广大投资者注意投资风险。特此公告。

本基金投资的前十名证券中的其它证券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。

本基金为指数基金,为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差,按照成份股权重进行配置该证券,符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程,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股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	4,162.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	193.46
5	应收申购款	20,375.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,731.03

### 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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### **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：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## **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
新丝路	925	7,642.50	25,698.45	0.36%	7,043,617.59	99.64%
新丝路 A	60	57,341.15	411,257.00	11.95%	3,029,212.00	88.05%
新丝路 B	276	12,465.47	163,500.00	4.75%	3,276,969.00	95.25%
合计	1,261	11,062.85	600,455.45	4.30%	13,349,798.59	95.70%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

新丝路

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	黄松友	740,420.00	38.23%
2	黄之林	355,875.00	18.38%
3	朱晓琴	110,741.00	5.72%
4	郑凯鹏	56,200.00	2.90%
5	罗黔	56,155.00	2.90%
6	谈兆广	51,495.00	2.66%
7	赵琼	35,605.00	1.84%
8	刘子惠	32,800.00	1.69%
9	王力	27,600.00	1.43%
10	殷茵	26,030.00	1.34%

新丝路 A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	李怡名	1,766,700.00	51.35%
2	黄松友	668,274.00	19.42%
3	海通证券资管—招商证券—海通怡然恒旭 1 号集合资产管理计划	338,590.00	9.84%
4	黄英	219,000.00	6.37%
5	梁小红	102,300.00	2.97%
6	向顺波	80,000.00	2.33%
7	深圳华智汇金资产管理有限公司—华智汇金量化一期证券投资基金	39,750.00	1.16%
8	深圳市衍盛资产管理有限公司—衍盛稳进	32,417.00	0.94%

9	郑志坤	30,000.00	0.87%
10	余志胜	28,605.00	0.83%

## 新丝路 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	余朝东	404,100.00	11.75%
2	李雯霏	377,100.00	10.96%
3	袁瑛政	292,547.00	8.50%
4	杨柏松	115,750.00	3.36%
5	黄芳	114,000.00	3.31%
6	林伟	110,154.00	3.20%
7	黄建辉	109,100.00	3.17%
8	周小军	100,000.00	2.91%
9	黄捷盛	95,107.00	2.76%
10	卢国辉	85,800.00	2.49%

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	新丝路	4,471.52	0.06%
	新丝路 A	-	-
	新丝路 B	-	-
	合计	4,471.52	0.03%

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的情况

注：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未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新丝路	新丝路 A	新丝路 B
基金合同生效日（2015 年 8 月 13 日） 基金份额总额	256,401,269.95	41,075,869.00	41,075,869.00
本报告期期初基金份额总额	14,034,355.31	4,241,419.00	4,241,419.00
本报告期基金总申购份额	6,528,860.62	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	15,095,799.89	-	-
本报告期基金拆分变动份额(份额减少 以“-”填列)	1,601,900.00	-800,950.00	-800,950.00
本报告期期末基金份额总额	7,069,316.04	3,440,469.00	3,440,469.00

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。

## § 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，经公司董事会审议通过，公司聘任韩亚庆先生担任公司副总经理。韩亚庆先生任职日期自 2017 年 3 月 22 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的重大人事变动：

本报告期内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

本基金本报告期基金投资策略未改变。

### 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
天风证券	1	5,384,741.64	36.35%	4,907.15	36.35%	本报告期新增
国金证券	1	4,846,664.50	32.72%	4,416.60	32.71%	-
招商证券	1	1,076,935.00	7.27%	981.39	7.27%	-
方正证券	1	770,592.41	5.20%	702.20	5.20%	-
广发证券	1	717,745.04	4.84%	654.16	4.85%	-
西南证券	2	508,442.00	3.43%	463.30	3.43%	-
浙商证券	1	484,980.00	3.27%	441.98	3.27%	本报告期新增
东北证券	1	437,121.00	2.95%	398.38	2.95%	-
川财证券	1	401,337.29	2.71%	365.75	2.71%	-
中泰证券	2	185,956.66	1.26%	169.44	1.26%	本报告期新增一个
安信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	本报告期新增
平安证券	1	-	-	-	-	本报告期新增

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：本基金本报告期内未通过券商交易单元进行债券交易、债券回购交易及权证交易。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与北京肯特瑞财富投资管理有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年1月10日
2	鹏华基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年1月10日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年1月14日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年1月17日
5	2016年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年1月19日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年2月10日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年2月11日
8	鹏华基金管理有限公司关于增加民生证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年3月1日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年3月8日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与浙江同花顺基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年3月20日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年3月22日

	变更的提示性公告	报》	
12	鹏华基金管理有限公司关于增加南京苏宁基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年3月22日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年3月23日
14	基金高级管理人员变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年3月23日
15	鹏华新丝路指数分级证券投资基金更新的招募说明书摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年3月25日
16	鹏华基金管理有限公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年3月30日
17	2016年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年3月30日
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年3月31日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年4月12日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年4月18日
21	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年4月20日
22	2017年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年4月24日
23	鹏华基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》、《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年4月25日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年4月25日
25	鹏华基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》、《上海证券交易所分级基金业	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017年4月26日

	务管理指引》实施的风险提示公告		
26	鹏华基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》、《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 27 日
27	鹏华基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》、《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 28 日
28	鹏华基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》、《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 29 日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 5 月 9 日
30	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 5 月 11 日
31	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 5 月 13 日
32	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 5 月 20 日
33	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 5 月 23 日
34	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 5 月 24 日
35	鹏华新丝路指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 6 月 3 日
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 6 月 27 日
37	鹏华基金管理有限公司关于网上直销交易系统升级切换及启用新版网上直销交易系统的提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 6 月 27 日

## § 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	20170101~20170305	9,183,203.00	-	9,183,203.00	-	0.00%
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、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、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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》;
- (二)《鹏华新丝路指数分级证券投资基金托管协议》;
- (三)《鹏华新丝路指数分级证券投资基金 2017 年半年度报告》(原文)。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层鹏华基金管理有限公司

深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦招商银行股份有限公司

### 12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站(<http://www.phfund.com>)查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司,本公司已开通客户服务系统,咨询电话:4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2017 年 8 月 28 日