

鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	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.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15

6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
7.7 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.....	48
7.8 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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53

10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	鹏华沪深 300ETF
场内简称	A300ETF
基金主代码	159927
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 7 月 19 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	8,192,168.00 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	2013 年 8 月 16 日

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。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法，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。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其风险与预期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。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。

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	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
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	北京市西城区金融街 25 号
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		何如	王洪章

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	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

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	-133,988.44
本期利润	2,756,236.51
加权平均基金份额本期利润	0.3364
本期加权平均净值利润率	9.83%
本期基金份额净值增长率	10.19%
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	11,291,683.67
期末可供分配基金份额利润	1.3784
期末基金资产净值	29,804,120.93
期末基金份额净值	3.6381
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	61.00%

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，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	5.24%	0.65%	4.98%	0.68%	0.26%	-0.03%
过去三个月	6.22%	0.61%	6.10%	0.62%	0.12%	-0.01%
过去六个月	10.19%	0.56%	10.78%	0.57%	-0.59%	-0.01%
过去一年	15.47%	0.66%	16.26%	0.67%	-0.79%	-0.01%
过去三年	67.51%	1.74%	69.36%	1.75%	-1.85%	-0.01%
自基金合同生效起至今	61.00%	1.61%	63.31%	1.62%	-2.31%	-0.01%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数

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

鹏华沪深300ETF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 2013 年 7 月 19 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		
崔俊杰	本基金基金经理	2013 年 7 月 19 日	-	9	崔俊杰先生，国籍中国，管理学硕士，9 年证券从业经验。2008 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任产品规划部产品设计师、量化投资部量化研究员，先后从事产品设计、量化研究工作，2013 年 3 月起担任鹏华深证民营 ETF 基金及其联接基金基金经理，2013 年 3 月起兼任鹏华上证民企 50ETF 基金及其联接基金基金经理，2013 年 7 月起兼任鹏华沪深 300ETF 基金基金经理，2014 年 12 月起兼任鹏华资源分级基金基金经理，2014 年 12 月起兼任鹏华传媒分级基金基金经理，2015 年 4 月起兼任鹏华银行分级基金基金经理，2015 年 8 月至 2016 年 7 月兼任鹏华医药分级（2016 年 7 月已转型为鹏华中证医药卫生（LOF））基金基金经理，2016 年 7 月起兼任鹏华中证医药卫生（LOF）基金基金经理，2016 年 11 月起兼任鹏华香港银行指数（LOF）

					基金基金经理，现同时担任量化及衍生品投资部副总经理。崔俊杰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

2017 年上半年，整个 A 股市场风格分化明显，资金偏向大盘蓝筹股，呈现震荡上行走势，波动率和成交量环比持平。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，力争跟踪指数收益，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

报告期末，本基金份额净值为 3.6381 元，累计净值 1.6100 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.19%。

本报告期基金日均跟踪偏离度的绝对值 0.006%，年化跟踪误差 0.565%。

对本基金而言，报告期内跟踪误差的主要来源为：样本股特殊事件导致的停复牌、成分股调整以及为应对申购赎回必要的现金留存等，对此我们采取了进一步的优化策略进行应对。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体来看，预计 2017 年的经济增速前高后低，但刺激政策频发，混改持续推进，地产销量超预期，稳保就业底线，汇率风险逐渐释放等已经逐渐得到大家的接受和认可。本质来讲，调结构与稳增长很难并行，若不破旧立新，经济结构的调整很难到位。促进改革、稳定增长和防范风险三者涵盖了中国经济的短期和长期、速度和效益之间的辩证关系，我们不可能只要长期不要短期，只要效益不要速度，因此我们预期在经济增长相对稳定之中，加快推动结构的调整，随着改革红利逐步释放，生产效率的逐渐提升，金融去杠杆的逐步推进，我国经济将健康稳步发展。

2017 年上半年以来宏观经济面临的问题较多，诸如货币政策的松紧，人民币汇率风险，房地产去库存如何执行，经济增速趋缓的刺激政策，IPO 加速，美元加息，资产荒等。这些问题及衍生的新问题的出现和解决将决定未来 A 股市场的走势，也许随着人民币汇率的逐步企稳，大类资产配置或许会逐步向股市转移，房地产去库存有效执行，银行坏账率持续降低，A 股市场整体估值将可能在未来一段时间平稳提升。但在市场波动中尤其要注意参与力度和风险控制，因此，我们建议继续密切关注与实体经济相关的宏观数据变化和政策信息。

我们仍然强调前期的观点：反复的经济形势势必带来资产之间轮动演绎的复杂化和高频率化，资产配置犯错的概率和机会成本相对较高，建议投资者从中长期投资的角度来考虑战略资产配置，避免短期频繁操作带来的风险。

本基金将积极应对各种因素对指数跟踪效果带来的冲击，努力将跟踪误差控制在基金合同规定的范围内，力争为投资者带来较好的投资回报。

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. 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。

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、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 11,291,683.67 元，期末基金份额净值 3.6381 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

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

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，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：鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	612,698.64	576,692.05
结算备付金		-	-
存出保证金		292.87	523.42
交易性金融资产	6.4.7.2	29,661,416.46	27,051,034.45
其中：股票投资		29,661,416.46	27,051,034.45
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	118.91	187.95
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		30,274,526.88	27,628,437.87
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		11,888.34	13,607.83
应付托管费		2,377.66	2,721.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,824.46	4,224.04
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	453,315.49	560,000.00
负债合计		470,405.95	580,553.45
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	18,512,437.26	18,512,437.26
未分配利润	6.4.7.10	11,291,683.67	8,535,447.16
所有者权益合计		29,804,120.93	27,047,884.42
负债和所有者权益总计		30,274,526.88	27,628,437.87

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.6381 元，基金份额总额 8,192,168.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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
一、收入		3,148,571.34	-7,461,294.62
1.利息收入		2,063.49	2,587.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,063.49	2,586.96
债券利息收入		-	0.96
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）		256,282.90	-104,127.46
其中：股票投资收益	6.4.7.12	12,848.56	-341,525.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	409.04
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	243,434.34	236,988.82
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,890,224.95	-7,345,721.20
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	-	-14,033.88
减：二、费用		392,334.83	400,691.38
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	69,465.54	72,828.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	13,893.15	14,565.70

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,510.65	11,611.95
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	303,465.49	301,685.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,756,236.51	-7,861,986.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,756,236.51	-7,861,986.00

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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）	18,512,437.26	8,535,447.16	27,047,884.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,756,236.51	2,756,236.51
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	18,512,437.26	11,291,683.67	29,804,120.93
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）	23,031,982.57	15,136,099.98	38,168,082.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,861,986.00	-7,861,986.00
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）	-4,519,545.30	24,612.45	-4,494,932.85
其中：1. 基金申购款	36,156,362.54	16,611,293.96	52,767,656.50
2. 基金赎回款	-40,675,907.84	-16,586,681.51	-57,262,589.35
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）	18,512,437.27	7,298,726.43	25,811,163.70

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

鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(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[2013]第 640 号《关于核准鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》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《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，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 1,306,495,157.00 元(含募集股票市值)，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(2013)第 380 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 7 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,306,582,851.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 87,694.00 份基金份额。本基金的基

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《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司确定 2013 年 8 月 8 日为本基金的基金份额折算日。当日沪深 300 指数收盘值为 2,276.782 点，本基金资产净值为 1,316,433,799.64 元，折算前基金份额总额为 1,306,582,851.00 份，折算前基金份额净值为 1.0075 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.44252786，折算后基金份额总额为 578,192,168.00 份，折算后基金份额净值为 2.2768 元。本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2013 年 8 月 9 日进行了变更登记。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上【2013】266 号文审核同意，本基金 578,192,168.00 份基金份额于 2013 年 8 月 16 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的标的指数为沪深 300 指数，投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；主要投资范围为标的指数成份股及其备选成份股(投资比例不低于基金资产净值的 95%)。此外，为更好的实现投资目标，本基金将少量投资于非标的指数成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、新股(首次发行或增发等)、金融衍生产品(权证、股指期货等)、债券及法律法规和中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数。

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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华沪深 300 交易型开放式指数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 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 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[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	612,698.64
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	612,698.64

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	26,588,329.72	29,661,416.46	3,073,086.74
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	26,588,329.72	29,661,416.46	3,073,086.74

注：股票投资项含可退替代款估值增值。

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	118.71
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	-
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	0.20
合计	118.91

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	2,824.46
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,824.46

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	-
预提费用	403,315.49
指数使用费	50,000.00
合计	453,315.49

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	8,192,168.00	18,512,437.26
本期申购	-	-

本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	8,192,168.00	18,512,437.26

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

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	25,231,160.17	-16,695,713.01	8,535,447.16
本期利润	-133,988.44	2,890,224.95	2,756,236.51
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,097,171.73	-13,805,488.06	11,291,683.67

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	2,027.53
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	33.15
其他	2.81
合计	2,063.49

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,848.56
股票投资收益——赎回差价收入	-

股票投资收益——申购差价收入	-
合计	12,848.56

6.4.7.12.2 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	2,015,146.24
减：卖出股票成本总额	2,002,297.68
买卖股票差价收入	12,848.56

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

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	243,434.34
基金投资产生的股利收益	-
合计	243,434.34

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	2,890,224.95
——股票投资	2,890,224.95
——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	2,890,224.95

6.4.7.18 其他收入

注：无。

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	5,510.65
银行间市场交易费用	-
合计	5,510.65

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	24,795.19
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	150.00
合计	303,465.49

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人

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	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管理费	69,465.54	72,828.45
其中：支付销售机构的客	-	-

户维护费		
------	--	--

注：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 0.5%，逐日计提，按月支付。

日管理费=前一日基金资产净值×0.5%÷当年天数。

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	13,893.15	14,565.70

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费年费率为 0.1%，逐日计提，按月支付。

日托管费=前一日基金资产净值×0.1%÷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未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
中国建设银行	612,698.64	2,027.53	686,252.36	2,292.47

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：本基金本报告期及上年度可比期间没有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

无。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1**

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
600050	中国联通	2017年4月5日	重大事项	7.47	2017年8月21日	8.22	24,701	151,061.18	184,516.47	-
601989	中国重工	2017年5月31日	重大事项	6.21	-	-	26,600	186,261.10	165,186.00	-
601088	中国神华	2017年6月5日	重大事项	22.29	-	-	5,725	89,602.34	127,610.25	-
600795	国电电力	2017年6月5日	重大事项	3.60	-	-	34,220	107,572.92	123,192.00	-
300104	乐视网	2017年4月17日	重大事项	30.68	-	-	3,500	166,245.85	107,380.00	-
000100	TCL集团	2017年4月21日	重大事项	3.43	2017年7月26日	3.72	21,380	75,015.89	73,333.40	-

600100	同方股份	2017年4月21日	重大事件	14.12	-	-	5,140	72,332.13	72,576.80	-
601727	上海电气	2017年6月22日	重大事件	7.57	2017年7月3日	7.54	8,900	77,164.69	67,373.00	-
600485	信威集团	2016年12月26日	重大事件	14.59	-	-	4,300	75,178.19	62,737.00	-
601919	中远海控	2017年5月17日	重大事件	5.35	2017年7月26日	5.89	11,100	61,704.33	59,385.00	-
002252	上海莱士	2017年4月21日	重大事件	20.24	-	-	2,860	61,857.64	57,886.40	-
000503	海虹控股	2017年5月11日	重大事件	24.93	-	-	2,100	92,511.06	52,353.00	-
600959	江苏有线	2017年6月19日	重大事件	10.57	-	-	4,440	48,648.25	46,930.80	-
002426	胜利精密	2017年1月16日	重大事件	7.68	-	-	5,000	45,399.59	38,400.00	-
600666	奥瑞德	2017年4月27日	重大事件	17.40	-	-	2,080	37,637.49	36,192.00	-
002049	紫光国芯	2017年2月20日	重大事件	30.82	2017年7月17日	27.74	1,100	36,561.88	33,902.00	-
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事件	8.27	-	-	4,080	40,772.36	33,741.60	-

		日	项							
601872	招商 轮船	2017 年 5 月 2 日	重 大 事 项	5.16	-	-	6,200	31,924.23	31,992.00	-
600654	*ST 中安	2017 年 6 月 7 日	重 大 事 项	13.48	-	-	2,300	44,273.08	31,004.00	-
601608	中信 重工	2017 年 4 月 19 日	重 大 事 项	5.54	2017 年 7 月 26 日	5.26	3,800	20,918.83	21,052.00	-

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

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中国建设银行股份有限公司，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

注：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	612,698.64	-	-	-	612,698.64
存出保证金	292.87	-	-	-	292.87
交易性金融资产	-	-	-	29,661,416.46	29,661,416.46
应收利息	-	-	-	118.91	118.91
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	612,991.51	-	-	29,661,535.37	30,274,526.88
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	11,888.34	11,888.34
应付托管费	-	-	-	2,377.66	2,377.66
应付交易费用	-	-	-	2,824.46	2,824.46
其他负债	-	-	-	453,315.49	453,315.49
负债总计	-	-	-	470,405.95	470,405.95
利率敏感度缺口	612,991.51	-	-	-29,191,129.42	29,804,120.93
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	576,692.05	-	-	-	576,692.05
存出保证金	523.42	-	-	-	523.42
交易性金融资产	-	-	-	27,051,034.45	27,051,034.45
应收利息	-	-	-	187.95	187.95
资产总计	577,215.47	-	-	27,051,222.40	27,628,437.87
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	13,607.83	13,607.83
应付托管费	-	-	-	2,721.58	2,721.58
应付交易费用	-	-	-	4,224.04	4,224.04
其他负债	-	-	-	560,000.00	560,000.00
负债总计	-	-	-	580,553.45	580,553.45
利率敏感度缺口	577,215.47	-	-	26,470,668.95	27,047,884.42

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。本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股，其投资比例不低于基金资产净值的 90%。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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 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	29,661,416.46	99.52	27,051,034.45	100.01
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	29,661,416.46	99.52	27,051,034.45	100.01

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%	1,474,729.66	1,342,353.04
业绩比较基准下降 5%	-1,474,729.66	-1,342,353.04	

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	29,661,416.46	97.97
	其中：股票	29,661,416.46	97.97
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	612,698.64	2.02
7	其他各项资产	411.78	0.00
8	合计	30,274,526.88	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2.1 的合计项不含可退替代款估值增值。

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	71,656.60	0.24
B	采矿业	956,076.59	3.21
C	制造业	10,647,185.91	35.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	806,868.90	2.71
E	建筑业	1,373,444.13	4.61
F	批发和零售业	634,834.87	2.13
G	交通运输、仓储和邮政业	862,896.09	2.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,547,385.57	5.19
J	金融业	10,202,813.37	34.23
K	房地产业	1,578,614.96	5.30
L	租赁和商务服务业	255,897.40	0.86
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	241,918.25	0.81
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	57,800.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	337,652.08	1.13
S	综合	86,371.74	0.29
	合计	29,661,416.46	99.52

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：无。

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	601318	中国平安	30,882	1,532,056.02	5.14
2	600036	招商银行	29,399	702,930.09	2.36
3	600519	贵州茅台	1,421	670,498.85	2.25
4	601166	兴业银行	35,620	600,553.20	2.02
5	000651	格力电器	13,758	566,416.86	1.90
6	000333	美的集团	12,905	555,431.20	1.86
7	600016	民生银行	67,560	555,343.20	1.86
8	000002	万科A	19,440	485,416.80	1.63
9	601328	交通银行	78,540	483,806.40	1.62
10	601668	中国建筑	42,820	414,497.60	1.39
11	600000	浦发银行	32,064	405,609.60	1.36
12	601288	农业银行	109,240	384,524.80	1.29
13	600030	中信证券	22,480	382,609.60	1.28
14	600887	伊利股份	17,302	373,550.18	1.25
15	600837	海通证券	23,089	342,871.65	1.15
16	002415	海康威视	10,525	339,957.50	1.14
17	601398	工商银行	61,680	323,820.00	1.09
18	601169	北京银行	34,714	318,327.38	1.07
19	600104	上汽集团	9,960	309,258.00	1.04
20	601601	中国太保	8,920	302,120.40	1.01
21	000858	五粮液	5,380	299,450.80	1.00

22	600900	长江电力	18,801	289,159.38	0.97
23	000725	京东方 A	67,880	282,380.80	0.95
24	601766	中国中车	27,776	281,093.12	0.94
25	601211	国泰君安	12,800	262,528.00	0.88
26	600276	恒瑞医药	4,782	241,921.38	0.81
27	000001	平安银行	24,490	229,961.10	0.77
28	601988	中国银行	60,207	222,765.90	0.75
29	600048	保利地产	20,347	202,859.59	0.68
30	600050	中国联通	24,701	184,516.47	0.62
31	601818	光大银行	45,540	184,437.00	0.62
32	600518	康美药业	8,480	184,355.20	0.62
33	601390	中国中铁	21,222	183,994.74	0.62
34	600028	中国石化	30,023	178,036.39	0.60
35	600019	宝钢股份	25,244	169,387.24	0.57
36	600015	华夏银行	18,307	168,790.54	0.57
37	601688	华泰证券	9,340	167,186.00	0.56
38	601989	中国重工	26,600	165,186.00	0.55
39	000063	中兴通讯	6,784	161,052.16	0.54
40	002450	康得新	7,064	159,081.28	0.53
41	601186	中国铁建	13,124	157,881.72	0.53
42	002304	洋河股份	1,700	147,577.00	0.50
43	000776	广发证券	8,455	145,848.75	0.49
44	001979	招商蛇口	6,763	144,457.68	0.48
45	601006	大秦铁路	16,920	141,958.80	0.48
46	600703	三安光电	6,988	137,663.60	0.46
47	000538	云南白药	1,437	134,862.45	0.45
48	600690	青岛海尔	8,700	130,935.00	0.44
49	600585	海螺水泥	5,660	128,651.80	0.43
50	601088	中国神华	5,725	127,610.25	0.43
51	601628	中国人寿	4,720	127,345.60	0.43
52	600958	东方证券	8,900	123,799.00	0.42
53	600795	国电电力	34,220	123,192.00	0.41
54	002024	苏宁云商	10,635	119,643.75	0.40
55	601336	新华保险	2,320	119,248.00	0.40
56	601939	建设银行	19,140	117,711.00	0.39
57	601901	方正证券	11,700	116,181.00	0.39
58	601009	南京银行	10,308	115,552.68	0.39
59	600999	招商证券	6,480	111,585.60	0.37
60	600340	华夏幸福	3,300	110,814.00	0.37

61	600089	特变电工	10,721	110,747.93	0.37
62	002230	科大讯飞	2,755	109,924.50	0.37
63	600309	万华化学	3,836	109,863.04	0.37
64	300104	乐视网	3,500	107,380.00	0.36
65	002142	宁波银行	5,556	107,230.80	0.36
66	600741	华域汽车	4,420	107,140.80	0.36
67	601857	中国石油	13,823	106,298.87	0.36
68	000423	东阿阿胶	1,462	105,103.18	0.35
69	601985	中国核电	13,300	103,873.00	0.35
70	600009	上海机场	2,770	103,348.70	0.35
71	601669	中国电建	13,040	103,276.80	0.35
72	600660	福耀玻璃	3,960	103,118.40	0.35
73	601899	紫金矿业	29,632	101,637.76	0.34
74	000568	泸州老窖	2,000	101,160.00	0.34
75	002241	歌尔股份	5,242	101,065.76	0.34
76	002456	欧菲光	5,500	99,935.00	0.34
77	601377	兴业证券	13,356	99,235.08	0.33
78	300070	碧水源	5,289	98,639.85	0.33
79	000166	申万宏源	17,195	96,292.00	0.32
80	300072	三聚环保	2,550	94,477.50	0.32
81	000069	华侨城 A	9,320	93,759.20	0.31
82	601607	上海医药	3,240	93,571.20	0.31
83	002236	大华股份	4,100	93,521.00	0.31
84	002736	国信证券	7,000	92,750.00	0.31
85	002466	天齐锂业	1,700	92,395.00	0.31
86	600886	国投电力	11,620	91,798.00	0.31
87	000338	潍柴动力	6,920	91,344.00	0.31
88	000783	长江证券	9,420	89,207.40	0.30
89	600031	三一重工	10,914	88,730.82	0.30
90	600068	葛洲坝	7,875	88,515.00	0.30
91	600196	复星医药	2,840	88,011.60	0.30
92	300059	东方财富	7,264	87,313.28	0.29
93	600029	南方航空	9,985	86,869.50	0.29
94	600010	包钢股份	39,045	85,508.55	0.29
95	601600	中国铝业	18,806	85,003.12	0.29
96	600066	宇通客车	3,800	83,486.00	0.28
97	002008	大族激光	2,400	83,136.00	0.28
98	601788	光大证券	5,500	82,115.00	0.28
99	601888	中国国旅	2,700	81,378.00	0.27

100	600606	绿地控股	10,400	81,328.00	0.27
101	000625	长安汽车	5,580	80,463.60	0.27
102	600637	东方明珠	3,704	80,265.68	0.27
103	601099	太平洋	19,415	78,048.30	0.26
104	600535	天士力	1,878	78,012.12	0.26
105	000839	中信国安	7,800	77,922.00	0.26
106	601933	永辉超市	10,920	77,313.60	0.26
107	002594	比亚迪	1,540	76,923.00	0.26
108	601555	东吴证券	6,820	76,588.60	0.26
109	601618	中国中冶	15,233	76,317.33	0.26
110	000413	东旭光电	6,700	75,174.00	0.25
111	600893	航发动力	2,740	74,802.00	0.25
112	600522	中天科技	6,100	73,505.00	0.25
113	600383	金地集团	6,394	73,339.18	0.25
114	000100	TCL 集团	21,380	73,333.40	0.25
115	000768	中航飞机	3,940	72,653.60	0.24
116	600406	国电南瑞	4,115	72,629.75	0.24
117	600100	同方股份	5,140	72,576.80	0.24
118	600705	中航资本	12,800	72,320.00	0.24
119	002475	立讯精密	2,450	71,638.00	0.24
120	300124	汇川技术	2,800	71,512.00	0.24
121	002673	西部证券	5,016	71,327.52	0.24
122	600111	北方稀土	6,221	70,483.93	0.24
123	600816	安信信托	5,180	70,396.20	0.24
124	600109	国金证券	5,970	69,968.40	0.23
125	002202	金风科技	4,480	69,305.60	0.23
126	601800	中国交建	4,340	68,962.60	0.23
127	601727	上海电气	8,900	67,373.00	0.23
128	000963	华东医药	1,336	66,399.20	0.22
129	002739	万达电影	1,300	66,261.00	0.22
130	000895	双汇发展	2,770	65,787.50	0.22
131	600570	恒生电子	1,400	65,352.00	0.22
132	600271	航天信息	3,140	64,809.60	0.22
133	600023	浙能电力	11,640	63,554.40	0.21
134	601018	宁波港	11,245	63,534.25	0.21
135	600739	辽宁成大	3,500	63,105.00	0.21
136	600485	信威集团	4,300	62,737.00	0.21
137	600547	山东黄金	2,140	61,910.20	0.21
138	600177	雅戈尔	6,088	61,610.56	0.21

139	600674	川投能源	6,266	61,532.12	0.21
140	601992	金隅股份	9,500	61,465.00	0.21
141	000728	国元证券	5,018	61,319.96	0.21
142	000623	吉林敖东	2,674	61,207.86	0.21
143	600352	浙江龙盛	6,420	61,182.60	0.21
144	600221	海航控股	18,800	60,536.00	0.20
145	601225	陕西煤业	8,500	60,095.00	0.20
146	300024	机器人	3,080	60,060.00	0.20
147	601919	中远海控	11,100	59,385.00	0.20
148	600018	上港集团	9,300	58,962.00	0.20
149	002065	东华软件	2,700	58,833.00	0.20
150	002252	上海莱士	2,860	57,886.40	0.19
151	002044	美年健康	3,400	57,800.00	0.19
152	000793	华闻传媒	5,700	57,684.00	0.19
153	002007	华兰生物	1,575	57,487.50	0.19
154	600115	东方航空	8,374	56,943.20	0.19
155	002508	老板电器	1,300	56,524.00	0.19
156	000157	中联重科	12,499	56,120.51	0.19
157	600804	鹏博士	3,160	56,090.00	0.19
158	603993	洛阳钼业	11,051	55,918.06	0.19
159	600415	小商品城	7,710	55,820.40	0.19
160	000540	中天金融	8,000	55,600.00	0.19
161	601111	中国国航	5,680	55,380.00	0.19
162	600436	片仔癀	900	54,936.00	0.18
163	600208	新湖中宝	12,200	54,900.00	0.18
164	601998	中信银行	8,720	54,848.80	0.18
165	600820	隧道股份	5,400	54,540.00	0.18
166	600085	同仁堂	1,540	53,838.40	0.18
167	601198	东兴证券	3,100	53,444.00	0.18
168	002465	海格通信	4,900	52,626.00	0.18
169	000503	海虹控股	2,100	52,353.00	0.18
170	600153	建发股份	4,014	51,901.02	0.17
171	000630	铜陵有色	18,025	51,191.00	0.17
172	000709	河钢股份	12,112	50,749.28	0.17
173	600157	永泰能源	14,209	50,726.13	0.17
174	002310	东方园林	3,000	50,160.00	0.17
175	000826	启迪桑德	1,410	49,519.20	0.17
176	300017	网宿科技	4,091	49,378.37	0.17
177	000876	新希望	6,000	49,320.00	0.17

178	000009	中国宝安	6,086	49,235.74	0.17
179	600489	中金黄金	4,896	49,106.88	0.16
180	002146	荣盛发展	4,970	49,053.90	0.16
181	000060	中金岭南	4,377	49,022.40	0.16
182	002081	金螳螂	4,461	48,981.78	0.16
183	600663	陆家嘴	2,060	48,698.40	0.16
184	601229	上海银行	1,900	48,526.00	0.16
185	600362	江西铜业	2,870	48,388.20	0.16
186	600170	上海建工	12,658	48,353.56	0.16
187	600061	国投安信	3,100	48,205.00	0.16
188	601155	新城控股	2,600	48,204.00	0.16
189	600332	白云山	1,640	47,625.60	0.16
190	002074	国轩高科	1,500	47,325.00	0.16
191	601216	君正集团	9,640	47,139.60	0.16
192	600959	江苏有线	4,440	46,930.80	0.16
193	002027	分众传媒	3,400	46,784.00	0.16
194	600118	中国卫星	1,680	46,771.20	0.16
195	300315	掌趣科技	5,700	46,512.00	0.16
196	002500	山西证券	4,840	46,367.20	0.16
197	000750	国海证券	8,292	45,606.00	0.15
198	600150	中国船舶	1,991	45,534.17	0.15
199	600297	广汇汽车	6,040	45,481.20	0.15
200	601633	长城汽车	3,400	45,186.00	0.15
201	600369	西南证券	8,040	45,104.40	0.15
202	000425	徐工机械	11,956	44,835.00	0.15
203	600008	首创股份	6,800	44,744.00	0.15
204	600682	南京新百	1,200	44,280.00	0.15
205	601333	广深铁路	9,682	43,762.64	0.15
206	300144	宋城演艺	2,000	41,740.00	0.14
207	600688	上海石化	6,200	40,982.00	0.14
208	000559	万向钱潮	3,856	40,950.72	0.14
209	000686	东北证券	4,020	40,401.00	0.14
210	000792	盐湖股份	3,840	40,128.00	0.13
211	002195	二三四五	5,560	39,754.00	0.13
212	000402	金融街	3,380	39,613.60	0.13
213	000983	西山煤电	4,500	39,465.00	0.13
214	601117	中国化学	5,600	39,144.00	0.13
215	600583	海油工程	6,240	38,937.60	0.13
216	300027	华谊兄弟	4,752	38,443.68	0.13

217	002426	胜利精密	5,000	38,400.00	0.13
218	600498	烽火通信	1,500	38,025.00	0.13
219	600718	东软集团	2,440	37,942.00	0.13
220	600373	中文传媒	1,600	37,616.00	0.13
221	002411	必康股份	1,300	37,596.00	0.13
222	600649	城投控股	3,575	37,573.25	0.13
223	300033	同花顺	600	37,326.00	0.13
224	600827	百联股份	2,287	37,163.75	0.12
225	600895	张江高科	2,200	37,136.00	0.12
226	600256	广汇能源	8,860	36,680.40	0.12
227	002385	大北农	5,800	36,482.00	0.12
228	002183	怡亚通	4,200	36,246.00	0.12
229	600666	奥瑞德	2,080	36,192.00	0.12
230	000917	电广传媒	3,200	36,160.00	0.12
231	600704	物产中大	4,935	35,976.15	0.12
232	600074	保千里	2,800	35,868.00	0.12
233	000415	渤海金控	5,300	35,669.00	0.12
234	600588	用友网络	2,056	35,198.72	0.12
235	000008	神州高铁	4,800	34,944.00	0.12
236	600060	海信电器	2,240	33,980.80	0.11
237	002049	紫光国芯	1,100	33,902.00	0.11
238	002470	金正大	4,500	33,885.00	0.11
239	002129	中环股份	4,080	33,741.60	0.11
240	600919	江苏银行	3,600	33,444.00	0.11
241	600376	首开股份	2,900	33,176.00	0.11
242	002602	世纪华通	900	32,634.00	0.11
243	601718	际华集团	3,700	32,523.00	0.11
244	601866	中远海发	9,020	32,472.00	0.11
245	600038	中直股份	700	32,039.00	0.11
246	601872	招商轮船	6,200	31,992.00	0.11
247	002174	游族网络	1,000	31,760.00	0.11
248	601997	贵阳银行	2,000	31,620.00	0.11
249	000959	首钢股份	4,500	31,455.00	0.11
250	600909	华安证券	3,100	31,279.00	0.10
251	600654	*ST 中安	2,300	31,004.00	0.10
252	002555	三七互娱	1,200	30,684.00	0.10
253	300168	万达信息	2,100	30,555.00	0.10
254	600977	中国电影	1,600	29,952.00	0.10
255	000977	浪潮信息	1,700	29,444.00	0.10

256	600037	歌华有线	2,000	29,120.00	0.10
257	000627	天茂集团	3,600	29,088.00	0.10
258	600021	上海电力	2,400	29,016.00	0.10
259	002152	广电运通	3,450	28,669.50	0.10
260	002558	巨人网络	600	27,732.00	0.09
261	600737	中粮糖业	2,900	27,376.00	0.09
262	002714	牧原股份	1,000	27,220.00	0.09
263	000671	阳光城	4,600	26,772.00	0.09
264	002352	顺丰控股	500	26,580.00	0.09
265	002131	利欧股份	8,000	26,320.00	0.09
266	600372	中航电子	1,490	25,881.30	0.09
267	600549	厦门钨业	1,200	25,788.00	0.09
268	000738	航发控制	1,300	25,441.00	0.09
269	002292	奥飞娱乐	1,500	25,350.00	0.09
270	600482	中国动力	1,000	25,290.00	0.08
271	000718	苏宁环球	4,300	25,198.00	0.08
272	601118	海南橡胶	4,420	25,105.60	0.08
273	600685	中船防务	900	24,642.00	0.08
274	600446	金证股份	1,400	24,612.00	0.08
275	000938	紫光股份	400	24,448.00	0.08
276	601877	正泰电器	1,200	24,108.00	0.08
277	000156	华数传媒	1,600	23,856.00	0.08
278	601021	春秋航空	700	23,541.00	0.08
279	601375	中原证券	2,300	23,138.00	0.08
280	002424	贵州百灵	1,200	22,632.00	0.08
281	300133	华策影视	1,960	21,952.00	0.07
282	601881	中国银河	1,800	21,348.00	0.07
283	601608	中信重工	3,800	21,052.00	0.07
284	000961	中南建设	3,200	20,864.00	0.07
285	002153	石基信息	900	20,457.00	0.07
286	300251	光线传媒	2,460	20,147.40	0.07
287	601958	金钼股份	2,769	19,853.73	0.07
288	002299	圣农发展	1,300	19,331.00	0.06
289	601163	三角轮胎	700	18,410.00	0.06
290	601611	中国核建	1,500	17,955.00	0.06
291	600233	圆通速递	900	17,631.00	0.06
292	600871	石化油服	5,100	17,034.00	0.06
293	600926	杭州银行	1,100	16,335.00	0.05
294	601966	玲珑轮胎	700	15,701.00	0.05

295	603858	步长制药	200	14,328.00	0.05
296	000555	神州信息	800	13,360.00	0.04
297	600188	兖州煤业	1,043	12,766.32	0.04
298	002797	第一创业	1,120	10,315.20	0.03
299	603160	汇顶科技	100	10,030.00	0.03
300	601127	小康股份	500	9,975.00	0.03
301	002839	张家港行	600	9,432.00	0.03
302	002831	裕同科技	100	7,500.00	0.03
303	002841	视源股份	100	7,422.00	0.02

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：无。

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	002415	海康威视	81,367.00	0.30
2	600522	中天科技	70,378.00	0.26
3	601992	金隅股份	64,784.00	0.24
4	002508	老板电器	63,406.00	0.23
5	002044	美年健康	55,440.00	0.20
6	600436	片仔癀	50,744.00	0.19
7	600682	南京新百	48,052.00	0.18
8	601229	上海银行	47,218.00	0.17
9	601117	中国化学	38,190.00	0.14
10	002411	必康股份	36,652.00	0.14
11	600919	江苏银行	33,624.00	0.12
12	002555	三七互娱	31,539.00	0.12
13	601997	贵阳银行	31,520.00	0.12
14	002602	世纪华通	31,509.00	0.12
15	600549	厦门钨业	31,356.00	0.12
16	600977	中国电影	31,200.00	0.12
17	000959	首钢股份	30,735.00	0.11

18	600909	华安证券	30,070.00	0.11
19	002456	欧菲光	28,118.00	0.10
20	600340	华夏幸福	27,836.00	0.10

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	601166	兴业银行	63,109.00	0.23
2	600867	通化东宝	59,860.41	0.22
3	601318	中国平安	53,949.00	0.20
4	002085	万丰奥威	51,635.00	0.19
5	000778	新兴铸管	45,781.86	0.17
6	601258	庞大集团	41,085.00	0.15
7	600839	四川长虹	37,656.76	0.14
8	300015	爱尔眼科	37,587.75	0.14
9	000039	中集集团	37,066.39	0.14
10	600519	贵州茅台	35,747.00	0.13
11	600875	东方电气	34,094.76	0.13
12	300058	蓝色光标	33,532.65	0.12
13	300002	神州泰岳	33,400.00	0.12
14	600252	中恒集团	32,487.00	0.12
15	600036	招商银行	30,944.00	0.11
16	600873	梅花生物	29,918.40	0.11
17	300182	捷成股份	29,580.00	0.11
18	601111	中国国航	28,672.00	0.11
19	002456	欧菲光	27,863.00	0.10
20	601200	上海环境	26,672.60	0.10

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	1,722,454.74
卖出股票收入（成交）总额	2,015,146.24

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 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。

7.8 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。

7.9 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

本基金投资的前十名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。

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	292.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	118.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	411.78

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

8.1.1 本基金的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
444	18,450.83	2,142,125.00	26.15%	6,050,043.00	73.85%

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	福建道冲投资管理有限公司一道冲 补天1号私募基金	720,479.00	8.79%
2	张杰	610,000.00	7.45%
3	张洪琴	478,704.00	5.84%
4	光大期货有限公司—光大期货道冲 水滴1号资产管理计划	409,500.00	5.00%
5	上海道策信息技术有限公司	383,013.00	4.68%
6	深圳市衍盛资产管理有限公司—衍 盛稳进	253,542.00	3.09%
7	中外建工程设计与顾问有限公司	231,646.00	2.83%
8	葛惠瑾	218,945.00	2.67%
9	刘宇峰	190,555.00	2.33%
10	余景妍	170,000.00	2.08%

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	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	0.00	0.00%

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的情况

项目	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	0

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

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（2013 年 7 月 19 日）基金份额总额	1,306,582,851.00
本报告期期初基金份额总额	8,192,168.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
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	8,192,168.00

§ 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

10.2.1 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。

10.2.2 基金托管人的重大人事变动：报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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			
光大证券	1	2,000,509.29	56.04%	1,823.41	56.04%	-
兴业证券	2	1,356,656.85	38.00%	1,236.37	38.00%	-
方正证券	2	212,783.00	5.96%	193.83	5.96%	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证 券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	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。

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
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17日
4	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
5	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
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11日

7	鹏华沪深 300 交易型开放式指数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 4 日
8	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
9	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
10	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 22 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
12	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
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下 A300ETF、民营 ETF 和民企 ETF 增加平安证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 3 月 27 日
14	关于鹏华基金管理有限公司旗下 A300ETF、民营 ETF 和民企 ETF 增加平安证券股份有限公司为申购赎回代理券商的更正公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 3 月 30 日
15	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
16	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
17	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
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下 A300ETF、民营 ETF 和民企 ETF 增加华西证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 4 月 14 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 18 日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下	《中国证券报》、《上	2017 年 4 月 20 日

	基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	海证券报》、《证券时报》	
21	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
22	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
23	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
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金增加华泰证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017 年 5 月 10 日
25	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
26	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
27	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
28	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
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 24 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 6 月 27 日
31	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

注：无。

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)《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
- (二)《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
- (三)《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 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

北京市西城区金融大街 25 号中国建设银行股份有限公司

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