

鹏华量化先锋混合型证券投资基金(原鹏 华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基 金)2018 年半年度报告

2018 年 06 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：2018 年 08 月 27 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 2018 年 8 月 24 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。

本基金系原鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金转型而来。鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金份额持有人大会于 2018 年 1 月 8 日表决通过了《关于鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》，鹏华基金管理有限公司决定对鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金进行基金份额折算和变更登记，转型为鹏华量化先锋混合型证券投资基金，基金份额折算基准日为 2018 年 2 月 22 日。根据《关于鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》、《鹏华基金管理有限公司关于鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》分别修订为《鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同》、《鹏华量化先锋混合型证券投资基金托管协议》，并据此编制《鹏华量化先锋混合型证券投资基金招募说明书》。鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金根据中国证监会《关于准予鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2017]1052 号）准予变更注册。《鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同》、《鹏华量化先锋混合型证券投资基金托管协议》将自鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算基准日的次一工作日起生效。

本报告中，原鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金报告期自 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 2 月 22 日止，鹏华量化先锋混合型证券投资基金报告期自 2018 年 2 月 23 日（基金合同生效日）

至 2018 年 6 月 30 日止。

本报告中财务资料未经审计。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	4
§ 2 基金简介	7
2.1 基金基本情况(转型后).....	7
2.2 基金基本情况(转型前).....	7
2.3 基金产品说明(转型后).....	7
2.4 基金产品说明(转型前).....	9
2.5 基金管理人和基金托管人.....	10
2.6 信息披露方式.....	10
2.7 其他相关资料.....	11
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	11
3.1 主要会计数据和财务指标.....	11
3.2 基金净值表现(转型后).....	12
3.3 基金净值表现(转型前).....	13
3.4 其他指标.....	13
§ 4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	19
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.....	19
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）	19
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	20
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	23
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）	44
6.1 资产负债表.....	44
6.2 利润表.....	45

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	46
6.4 报表附注.....	47
§ 7 投资组合报告(转型后).....	65
7.1 期末基金资产组合情况.....	65
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	65
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.....	66
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	70
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.....	70
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.....	71
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.....	71
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.....	71
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	71
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	71
7.12 投资组合报告附注.....	71
§ 7 投资组合报告(转型前).....	72
7.1 期末基金资产组合情况.....	72
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	73
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.....	74
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	81
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	81
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.....	82
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.....	82
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.....	82
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.....	82
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	82
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	82
7.12 投资组合报告附注.....	83
§ 8 基金份额持有人信息(转型后).....	84
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	84
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	84
8.3 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.....	84
§ 8 基金份额持有人信息(转型前).....	84
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	84
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	84
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	85
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.....	85
§ 9 开放式基金份额变动（转型后）.....	85
§ 9 开放式基金份额变动（转型前）.....	85
§ 10 重大事件揭示.....	86

10.1 基金份额持有人大会决议.....	86
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.....	86
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	86
10.4 基金投资策略的改变.....	86
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	86
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.....	86
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后).....	86
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前).....	89
10.9 其他重大事件(转型后).....	92
10.10 其他重大事件(转型前).....	95
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息（转型后）.....	96
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.....	96
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	97
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息（转型前）.....	97
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.....	97
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	97
§ 12 备查文件目录.....	97
12.1 备查文件目录.....	97
12.2 存放地点.....	98
12.3 查阅方式.....	98

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况(转型后)

基金名称	鹏华量化先锋混合型证券投资基金
基金简称	鹏华量化先锋混合
场内简称	-
基金主代码	005632
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	2018 年 2 月 23 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	31,263,101.07 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

2.2 基金基本情况(转型前)

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	32,712,954.48 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

2.3 基金产品说明(转型后)

投资目标	本基金通过运用量化选股策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，结合适当的资产配置策略，并依靠严格的投资纪律和风险控制，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。 1、资产配置策略 本基金通过对宏观环境和

政策导向的分析等构建数量化模型，以对大类资产风险收益状态、投资者行为、市场情绪、市场风险偏好等进行系统分析和评估。本基金根据基本面分析框架、现代投资组合理论以及风险预算模型对大类资产进行综合评估，确定大类资产配置权重，同时合理使用金融工具实现对组合风险暴露的动态调整。

2、股票投资策略 本基金对股票的投资采用“自上而下”的行业配置策略以及“自下而上”的量化选股策略，在纪律化模型约束下，根据市场变化趋势，对模型进行动态调整。

(1) 行业配置策略 本基金的行业配置策略综合考虑行业的基本面、现代投资组合理论以及风险预算模型，结合定性和定量分析作出行业配置决策，在基金整体风险水平可控的前提下，实现各行业的合理配置和优化。

(2) 量化选股策略 本基金将以多因子选股策略构建股票投资组合。多因子选股策略的信息主要来自于基本面、预期数据、市场交易数据等，每一类信息代表一种选股逻辑。在不同的市场环境下，选股逻辑会有不同的侧重点。基于不同的选股逻辑，构建个股维度的多因子选股策略，包括价值、基本面、市场、成长、预期等，并对因子的有效性进行情景分析和动态监控，筛选出有效因子组合，构建股票资产组合。本基金在股票投资组合构建完成后，将根据个股价格波动、风险收益变化的实际情况，定期或不定期调整个股权重，以确保整个股票组合的风险处于可控范围内。

3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略、中小企业私募债投资策略等积极投资策略，灵活地调整组合的券种搭配，精选安全边际较高的个券。

(1) 久期策略 久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。

(2) 收益率曲线策略 收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，并进行动态调整。

(3) 骑乘策略 本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略，以达到增强组合的持有期收益的目的。

(4) 息差策略 本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。

(5) 个券选择策略 本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。

(6) 信用策略 本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。

(7) 中小企业私募债投资策略 本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，与中小企业私募债券承销券商紧密合作，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，力求规避可能存在的债券违约，并获取超额收益。

4、权证投资策略 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。

5、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

	6、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	沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

注:无。

2.4 基金产品说明(转型前)

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	<p>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。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%。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。本基金可投资权证、股指期货和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。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。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。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。本基金通过久期配置、类属配置、期限结构配置等，采取积极主动的投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现债券组合增值。</p> <p>1、构建投资组合 构建基金投资组合的过程主要分为三步：确定目标组合、制定建仓策略和逐步调整组合。本基金采取完全复制法确定目标组合，主要投资范围为标的指数成份股及其备选成份股。基金管理人将对标的指数成份股的流动性和交易成本等因素进行分析，制定合理的建仓策略，并在基金合同生效之日起 3 个月内达到合同约定的投资比例。此后，如因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、基金申购或赎回带来现金、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金不符合这一投资比例的，基金管理人将在 10 个工作日内进行调整。</p> <p>2、日常投资组合管理 (1) 可能引起跟踪误差各种因素的跟踪与分析：基金管理人将对标的指数成份股的调整、股本变化、分红、停/复牌、市场流动性、标的指数编制方法的变化、基金每日申购赎回情况等因素</p>

	进行密切跟踪，分析其对指数跟踪的影响。（2）投资组合的调整：利用数量化分析模型，优选组合调整方案，并利用自动化指数交易系统调整投资组合，以实现更好的跟踪标的指数的目的。（3）编制并公告申购赎回清单：以 T-1 日基金持有的证券及其比例为基础，根据上市公司公告，考虑 T 日可能发生的上市公司变动情况，编制 T 日的申购赎回清单并公告。3、定期投资组合管理 基金管理人将定期（每月或每半年）进行投资组合管理，主要完成下列事项：（1）定期对投资组合的跟踪误差进行归因分析，制定改进方案；（2）根据标的指数的编制规则及调整公告，制定组合调整方案；（3）根据本基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行每月支付现金的准备。4、投资绩效评估（1）每日对基金的绩效进行评估，主要是对跟踪偏离度进行评估；（2）每月末，金融工程小组对基金的运行情况进行量化评估；（3）每月末，基金经理根据量化评估报告，重点分析基金的跟踪偏离度和跟踪误差产生原因、现金的控制情况、标的指数调整成份股前后的操作、未来成份股的变化等。
业绩比较基准	标的指数，即沪深 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。

注：无。

2.5 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
	联系电话	0755-82825720
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn
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 楼	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 楼	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	田国立

2.6 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

2.7 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号 深圳国际商会中心第 43 层

§ 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（2018 年 1 月 1 日-2018 年 6 月 30 日）	
	转型前 报告期（2018 年 1 月 1 日-2018 年 2 月 22 日（基金合同失效日））	转型后 报告期（2018 年 2 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-273,690.00	-2,270,015.15
本期利润	61,463.54	-6,908,089.56
加权平均基金份额本期利润	0.0075	-0.2053
本期加权平均净值利润率	0.18%	-22.22%
本期基金份额净值增长率	0.19%	-21.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018 年 2 月 22 日（基金合同结束日））	报告期末（2018 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	14,200,517.23	6,719,574.86
期末可供分配基金份额利润	0.4341	0.2149
期末基金资产净值	32,712,954.49	24,411,432.00
期末基金份额净值	1.0000	0.7808
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2018 年 2 月 22 日（基金合同结束日））	报告期末（2018 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	76.71%	-21.92%

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，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，转型前为 2 月 22 日，转型后为 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

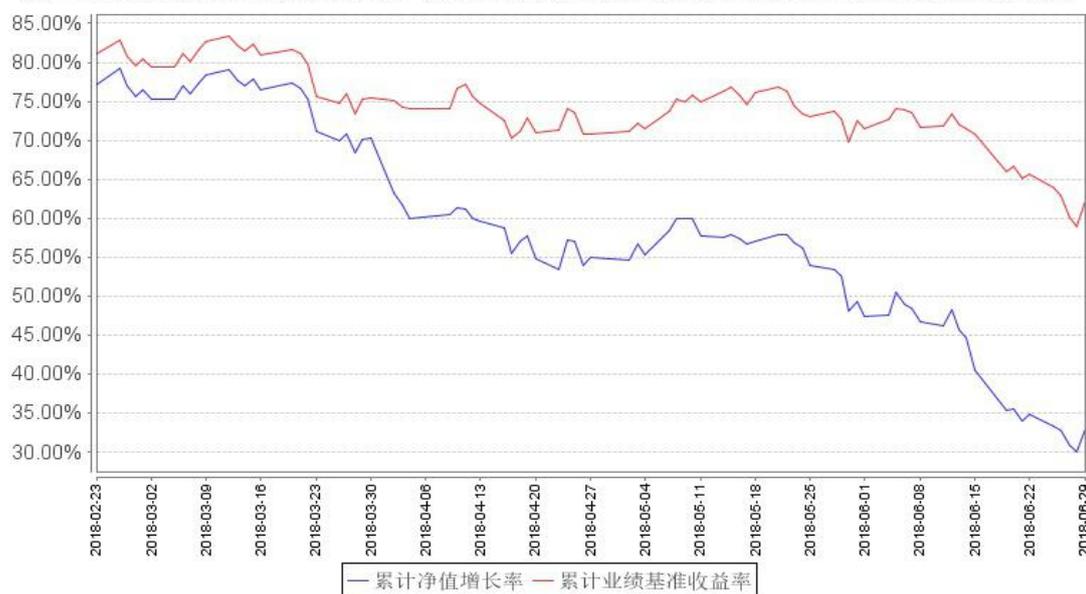
3.2 基金净值表现(转型后)

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	-10.90	1.41	-6.03	1.02	-4.87	0.39
过去三个月	-18.99	1.19	-7.58	0.91	-11.41	0.28
过去六个月	-21.92	1.09	-10.15	0.87	-11.77	0.22
过去一年	-21.92	1.09	-10.15	0.87	-11.77	0.22
自基金成立起至今	-21.92	1.09	-10.15	0.87	-11.77	0.22

3.2.2 自基金转型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

鹏华量化先锋混合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



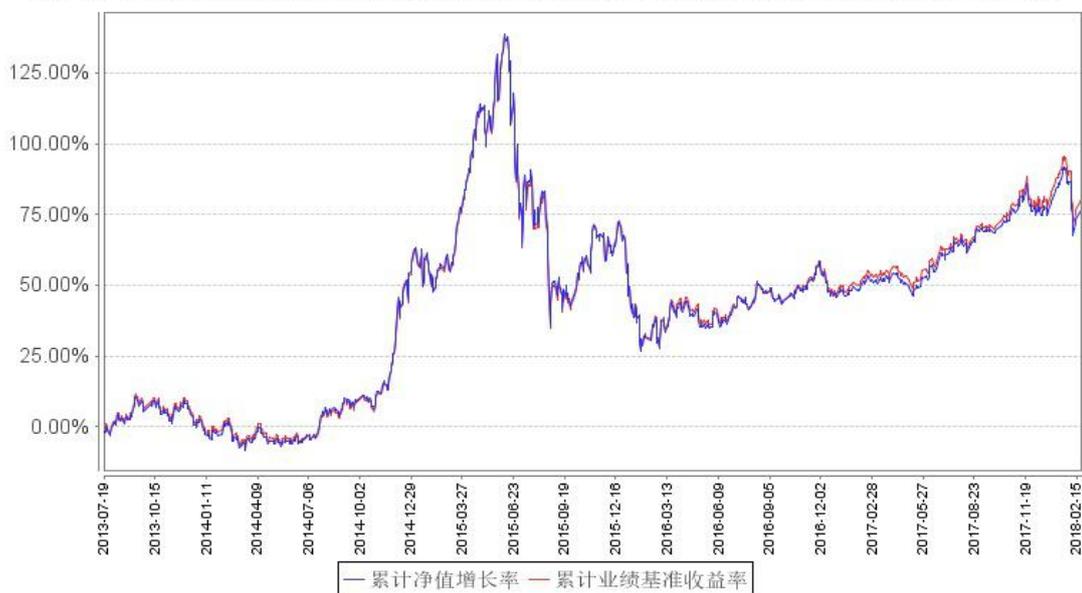
3.3 基金净值表现(转型前)

3.3.1 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 (%)
过去六个月	0.19	1.30	0.54	1.31	-0.35	-0.01
过去一年	9.76	0.85	10.53	0.86	-0.77	-0.01
过去三年	-11.58	1.52	-9.40	1.53	-2.18	-0.01
自基金成立起至今	76.71	1.52	80.50	1.54	-3.79	-0.02

3.3.2 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



3.4 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 2018 年 6 月，公司管理资产总规模达到 5,232.30 亿元，管理 152 只公募基金、10 只全国社保投资组合、3 只基本养老保险投资组合。经过近 20 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(转型后)

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	-	2013 年 7 月 19 日	-	7	崔俊杰先生，国籍中国，金融工程专业管理学硕士，7 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 月起兼任鹏华医药分级基金基金经理。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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介(转型前)

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	2013-07-19	2018-02-23	10	崔俊杰先生，国籍中国，管理学硕士，10 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 03 月担任鹏华深证民营 ETF 基金基金经理，2013 年 03 月担任鹏华深证民营 ETF 联接基金基金经理，2013 年 03 月担任鹏华上证民企 50ETF 联接基金基金经理，2013 年 03 月担任鹏华上证民企 50ETF 基金基金经理，2013 年 07 月至 2018 年 02 月担任鹏华沪深 300ETF

					<p>(2018年2月已转型为鹏华量化先锋混合)基金基金经理, 2014年12月担任鹏华资源分级基金基金经理, 2014年12月担任鹏华传媒分级基金基金经理, 2015年04月担任鹏华银行分级基金基金经理, 2015年08月至2016年07月担任鹏华医药分级基金基金经理, 2016年07月担任鹏华中证医药卫生(LOF)基金基金经理, 2016年11月担任鹏华香港银行指数(LOF)基金基金经理, 2018年02月至2018年03月担任鹏华量化先锋混合基金基金经理, 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发生变动。</p>
--	--	--	--	--	--

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

2018 年组合运作期内，整个 A 股市场波动剧烈，市场先扬后抑，风格分化较大，波动率和成交量相对去年有所提升。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

本报告期基金转型前份额净值增长率为 0.19%，业绩比较基准净值增长率 0.54%；基金转型后份额净值增长率为-21.92%，业绩比较基准净值增长率-10.15%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年下半年，中国的宏观经济大概率稳中趋缓。随着国内消费日益成为经济增长的支撑力量，我们认为经济大幅下行的可能性不大，但是由于贸易战等外部不确定因素的存在，对经济增长可能会有一定的影响。2018 年金融改革进展显著，对市场也造成了相当的冲击，这种格局在 2018 年下半年将开始发生一些变化。随着中国经济结构调整的推进，代表新经济的优质成长股将脱颖而出。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1) 日常估值流程

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

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

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

(2) 特殊业务估值流程

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

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

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

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4. 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 6,719,574.86 元，期末基金份额净值 0.7808 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

本基金自 2018 年 5 月 25 日至 2018 年 6 月 29 日期间出现连续二十个（或以上）工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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）（转型后）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华量化先锋混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	3,924,373.23
结算备付金		542,950.92
存出保证金		16,299.89
交易性金融资产	6.4.7.2	20,430,198.93
其中：股票投资		20,430,198.93
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	1,032.89
应收股利		-
应收申购款		918.63
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		24,915,774.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 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		14,493.49
应付管理人报酬		32,055.70
应付托管费		5,342.59
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	95,857.97
应交税费		1.34
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	356,591.40
负债合计		504,342.49
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	17,691,857.14
未分配利润	6.4.7.10	6,719,574.86
所有者权益合计		24,411,432.00
负债和所有者权益总计		24,915,774.49

注：(1) 报告截止日 2018 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7808 元，基金份额总额 31,263,101.07 份。

(2) 本基金合同生效日为 2018 年 2 月 23 日，无上年末可比较数据。

6.2 利润表

会计主体：鹏华量化先锋混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 2 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2018 年 2 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		-6,444,293.54
1. 利息收入		27,039.90
其中：存款利息收入	6.4.7.11	17,334.41
债券利息收入		43.35
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		9,662.14
其他利息收入		-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,995,615.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,115,415.41
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	8,835.29
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-
收益		
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	110,964.48
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-4,638,074.41
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	162,356.61
减：二、费用		463,796.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	161,455.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	26,909.26
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	187,829.95
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.15
7. 其他费用	6.4.7.20	87,601.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,908,089.56
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,908,089.56

注：本基金合同生效日为 2018 年 2 月 23 日，无上年可比较期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华量化先锋混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 2 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 2 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有	18,512,437.26	14,200,517.23	32,712,954.49

者权益 (基金 净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,908,089.56	-6,908,089.56
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)	-820,580.12	-572,852.81	-1,393,432.93
其中：			
1. 基金申购款	12,880,653.20	8,159,465.60	21,040,118.80
2. 基金赎回款	-13,701,233.32	-8,732,318.41	-22,433,551.73
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	17,691,857.14	6,719,574.86	24,411,432.00

净值)			
-----	--	--	--

注:本基金合同生效日为 2018 年 2 月 23 日,无上年可比较期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>邓召明</u>	<u>苏波</u>	<u>郝文高</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华量化先锋混合型证券投资基金是根据原鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“鹏华沪深 300ETF 基金”)基金份额持有人大会于 2018 年 1 月 8 日决议通过的《关于鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》,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[2017]1052 号《关于准予鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复》核准,由鹏华沪深 300ETF 基金转型而来。原鹏华沪深 300ETF 基金存续期限至 2018 年 2 月 22 日止。自 2018 年 2 月 23 日起,原鹏华沪深 300ETF 基金更名为鹏华量化先锋混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》失效的同时《鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

原鹏华沪深 300ETF 基金失效前的基金资产净值为 32,712,954.49 元,已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金份额折算和变更登记结果公告》的有关规定,本基金的基金管理人于 2018 年 2 月 22 日日终对投资者持有的鹏华沪深 300ETF 基金基金份额变更登记为本基金基金份额,基金份额总额为 32,712,954.48 份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等)、货币市场工具(含同业存单等)、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投

投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%—95%；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，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%。

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》、《深证民营交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 2 月 23 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日止期间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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 2 月 23 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 2 月 23 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记帐本位币，除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的

公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费（如有）在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类/级别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部

分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，

不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

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

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

6.4.7 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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	3,924,373.23
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月及以上	-
其他存款	-
合计	3,924,373.23

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	21,990,401.19	20,430,198.93	-1,560,202.26
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	21,990,401.19	20,430,198.93	-1,560,202.26

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 2018年6月30日
应收活期存款利息	781.19
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	244.30
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
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	7.40
合计	1,032.89

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
----	-----

	2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	95,857.97
银行间市场应付交易费用	-
合计	95,857.97

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	35.29
预提费用	356,556.11
合计	356,591.40

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 2 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	32,712,954.48	18,512,437.26
本期申购	22,760,510.65	12,880,653.20
本期赎回（以“-”号填列）	-24,210,364.06	-13,701,233.32
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	31,263,101.07	17,691,857.14

注：原鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金于基金合同失效前的基金资产净值为 32,712,954.49 元，已于本基金基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。

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
基金合同生效日	28,100,455.90	-13,899,938.67	14,200,517.23
本期利润	-2,270,015.15	-4,638,074.41	-6,908,089.56
本期基金份额交易产生的变动数	-1,292,951.25	720,098.44	-572,852.81
其中：基金申购款	20,193,640.20	-12,034,174.60	8,159,465.60
基金赎回款	-21,486,591.45	12,754,273.04	-8,732,318.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,537,489.50	-17,817,914.64	6,719,574.86

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年2月23日（基金合同生效日）至2018年6月30日
活期存款利息收入	16,333.01
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	963.64
其他	37.76
合计	17,334.41

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
	2018年2月23日（基金合同生效日）至2018年6月30日
卖出股票成交总额	64,740,172.32
减：卖出股票成本总额	66,855,587.73
买卖股票差价收入	-2,115,415.41

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

单位：人民币元

项目	本期
	2018年2月23日（基金合同生效日）至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	8,835.29
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	8,835.29

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年2月23日（基金合同生效日）至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	629,256.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	619,949.92
减：应收利息总额	470.79
买卖债券差价收入	8,835.29

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 2018年2月23日(基金合同生效日)至2018年 6月30日
股票投资产生的股利收益	110,964.48
基金投资产生的股利收益	-
合计	110,964.48

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2018年2月23日(基金合同生效 日)至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-4,638,074.41
股票投资	-4,638,074.41
债券投资	-
资产支持证券投资	-

基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-4,638,074.41

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月23日（基金合同生效日）至2018年6月30日
基金赎回费收入	162,356.61
合计	162,356.61

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月23日（基金合同生效日）至2018年6月30日
交易所市场交易费用	187,829.95
银行间市场交易费用	-
合计	187,829.95

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月23日（基金合同生效日）至2018年6月30日
审计费用	15,781.12
信息披露费	70,679.39
债券托管账户维护费	-
银行划款手续费	1,140.70
指数使用费	-
上市年费	-
红利手续费	-
其他	-
合计	87,601.21

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（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金基金合同于 2018 年 2 月 23 日生效，截止本报告期末不满一年。无上年度可比期间和数据。

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 2018年2月23日(基金合同生效日)至2018 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	161,455.45
其中：支付销售机构的客户维护费	3,737.52

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月23日(基金合同生效日)至2018 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	26,909.26

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 0.25%，逐日计提，按月支付。

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.10.2.3 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：无。

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 2018年2月23日（基金合同生效日）至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	3,924,373.23	16,333.01

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

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末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
300072	三聚环保	2018年6月19日	重大事项	23.28	2018年7月10日	24.00	24,350	698,380.99	566,868.00	-
300197	铁汉生态	2018年5月28日	重大事项	5.37	-	-	29,850	210,260.75	160,294.50	-
600221	海航控股	2018年1月10日	重大事项	3.23	2018年7月20日	2.91	32,200	103,116.76	104,006.00	-
002252	上海莱士	2018年2月23日	重大事项	21.47	-	-	4,160	84,583.17	89,315.20	-
000540	中天	2017年	重大事	4.18	-	-	12,150	55,131.01	50,787.00	-

	金融	8月21日	项							
002739	万达电影	2017年7月4日	重大事项	38.03	-	-	1,300	84,428.88	49,439.00	-
600485	信威集团	2016年12月26日	重大事项	10.24	-	-	4,300	75,178.19	44,032.00	-
002310	东方园林	2018年5月25日	重大事项	13.08	-	-	3,000	55,495.07	39,240.00	-
000415	渤海金控	2018年1月17日	重大事项	5.84	2018年7月17日	5.26	5,100	34,619.17	29,784.00	-

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

注: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

本基金为股票型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。

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,使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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，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 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

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、组合在短期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。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。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约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。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制），本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融

资产和金融负债不计息，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 2018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	3,924,373.23	-	-	-	3,924,373.23
结算备付金	542,950.92	-	-	-	542,950.92
存出保证金	16,299.89	-	-	-	16,299.89
交易性金融资产	-	-	-	20,430,198.93	20,430,198.93
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,032.89	1,032.89
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	918.63	918.63
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,483,624.04	-	-	20,432,150.45	24,915,774.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	14,493.49	14,493.49
应付管理人报酬	-	-	-	32,055.70	32,055.70
应付托管费	-	-	-	5,342.59	5,342.59
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	95,857.97	95,857.97
应付利息	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	1.34	1.34
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	356,591.40	356,591.40
负债总计	-	-	-	504,342.49	504,342.49
利率敏感度缺口	4,483,624.04	-	-	-19,927,807.96	24,411,432.00

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2018 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%。

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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金为股票型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。

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 2018年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	20,430,198.93	83.69
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	20,430,198.93	83.69

注：无。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注:于 2018 年 6 月 30 日,由于本基金运行期间不足一年,尚不存在足够的经验数据,因此,无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注: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

无。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

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：2018 年 2 月 22 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 2 月 22 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	539,355.53	639,503.56
结算备付金		-	-
存出保证金		101.89	138.90
交易性金融资产	6.4.7.2	32,674,750.56	32,588,174.76
其中：股票投资		32,674,750.56	32,588,174.76
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	732.11	140.69
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		33,214,940.09	33,227,957.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 2 月 22 日	上年度末 2017 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		10,295.49	14,971.30
应付托管费		2,059.12	2,994.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	90.95	3,501.40
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	489,540.04	555,000.00
负债合计		501,985.60	576,466.96
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	14,200,517.23	14,139,053.69
所有者权益合计		32,712,954.49	32,651,490.95
负债和所有者权益总计		33,214,940.09	33,227,957.91

注：报告截止日 2018 年 02 月 22 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 32,712,954.48 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 2 月 22 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 2 月 22 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		193,041.46	3,148,571.34
1. 利息收入		591.42	2,063.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	591.42	2,063.49
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）		-142,703.50	256,282.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-148,768.74	12,848.56
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	6,065.24	243,434.34
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	335,153.54	2,890,224.95
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	-	-
减：二、费用		131,577.92	392,334.83
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	24,848.50	69,465.54
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,969.72	13,893.15
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	199.66	5,510.65
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	101,560.04	303,465.49
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		61,463.54	2,756,236.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		61,463.54	2,756,236.51

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 2 月 22 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 2 月 22 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	14,139,053.69	32,651,490.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	61,463.54	61,463.54
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	14,200,517.23	32,712,954.49
项目	上年度可比期间 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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

苏波

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华沪深 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(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》、《深证民营交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规

定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 2 月 22 日（基金最后运作日）止期间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 2018 年 2 月 22 日（基金最后运作日）的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 2 月 22 日（基金最后运作日）止期间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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

6.4.7 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 2018 年 2 月 22 日
活期存款	539,355.53
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月及以上	-
其他存款	-
合计	539,355.53

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 2 月 22 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	29,596,878.41	32,674,750.56	3,077,872.15
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	29,596,878.41	32,674,750.56	3,077,872.15

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 2018年2月22日
应收活期存款利息	708.11
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	24.00
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
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	-
合计	732.11

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 2018年2月22日
交易所市场应付交易费用	90.95
银行间市场应付交易费用	-
合计	90.95

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 2 月 22 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
指数使用费	29,444.44
预提费用	460,095.60
合计	489,540.04

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 2 月 22 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	8,192,168.00	8,192,168.00
基金拆分/份额折算调整	24,520,786.48	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	32,712,954.48	18,512,437.26

注：（1）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。

（2）根据《鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金份额折算和变更登记的公告》，本基金的基金管理人确定 2018 年 2 月 22 日为份额折算基准日，对原鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金进行基金份额折算和变更登记。

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	28,374,145.90	-14,235,092.21	14,139,053.69
本期利润	-273,690.00	335,153.54	61,463.54
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	28,100,455.90	-13,899,938.67	14,200,517.23

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 2 月 22 日

活期存款利息收入	567.42
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	24.00
其他	-
合计	591.42

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 2018年1月1日至2018年2月22日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-148,768.74
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	-148,768.74

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 2018年1月1日至2018年2月22日
卖出股票成交总额	99,809.00
减：卖出股票成本总额	248,577.74
买卖股票差价收入	-148,768.74

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 2018年1月1日至2018年2月22日
股票投资产生的股利收益	6,065.24
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,065.24

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年2月22日
1. 交易性金融资产	335,153.54
股票投资	335,153.54
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-

权证投资	
3. 其他	
减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增值 税	
合计	335,153.54

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
	2018年1月1日至2018年2月22日
交易所市场交易费用	199.66
银行间市场交易费用	-
合计	199.66

6.4.7.20 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年2月22日
审计费用	6,534.37
信息披露费	43,561.23
银行汇划费用	20.00
指数使用费	29,444.44
上市年费	10,000.00
其他	12,000.00
合计	101,560.04

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(“鹏华基金公司”)	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
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、基金的一级交易商

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 2018年1月1日至2018年2 月22日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	24,848.50	69,465.54
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:1、支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为0.50%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.50%÷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
----	----	---------

	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 2 月 22 日	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,969.72	13,893.15

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:无。

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 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 2 月 22 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 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	539,355.53	567.42	612,698.64	2,027.53

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

无。

6.4.11 利润分配情况

注:无。

6.4.12 期末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
601600	中国铝业	2017年9月12日	重大事项	8.09	2018年2月26日	7.28	18,806	79,998.65	152,140.54	-
600309	万华化学	2017年12月5日	重大事项	36.44	2018年6月4日	40.08	3,936	68,285.33	143,427.84	-
002450	康得新	2018年6月4日	重大事项	19.78	-	-	5,864	125,058.47	115,989.92	-
600221	海航控股	2018年1月10日	重大事项	3.25	2018年7月20日	2.91	32,200	103,116.76	104,650.00	-
002739	万达电影	2017年7月4日	重大事项	52.04	-	-	1,300	84,428.88	67,652.00	-
600485	信威集团	2016年12月26日	重大事项	14.59	-	-	4,300	75,178.19	62,737.00	-
000540	中天金融	2017年8月21日	重大事项	7.35	-	-	8,100	55,131.01	59,535.00	-
600804	鹏博士	2018年2月9日	重大事项	12.52	2018年3月12日	13.77	3,960	80,417.56	49,579.20	-
600150	中国船舶	2017年9月27日	重大事项	24.67	2018年3月21日	22.20	1,991	53,219.39	49,117.97	-
600157	永泰能源	2017年11月21日	重大事项	3.36	2018年4月4日	3.03	14,209	58,279.09	47,742.24	-
601216	君正集团	2017年12月15日	重大事项	4.71	2018年4月19日	4.71	9,440	44,581.09	44,462.40	-
600682	南京新百	2018年2月2日	重大事项	33.28	2018年6月7日	29.95	1,300	48,053.69	43,264.00	-
600666	奥瑞	2017年	重大事	17.40	2018	15.66	2,080	37,637.49	36,192.00	-

	德	4月27日	项		年5月4日					
000415	渤海金控	2018年1月17日	重大事项	5.84	2018年7月17日	5.26	5,100	34,619.17	29,784.00	-
600685	中船防务	2017年9月27日	重大事项	26.66	2018年3月21日	24.05	900	27,137.05	23,994.00	-

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

注: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

可承受的范围內。

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 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2017 年 12 月 31 日：未持有）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

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、组合在短期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。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注:无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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 2018年2月22日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	539,355.53	-	-	-	539,355.53
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	101.89	-	-	-	101.89
交易性金融资产	-	-	-	32,674,750.56	32,674,750.56
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	732.11	732.11
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	539,457.42	-	-	32,675,482.67	33,214,940.09
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	10,295.49	10,295.49
应付托管费	-	-	-	2,059.12	2,059.12
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	90.95	90.95
应付利息	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	489,540.04	489,540.04
负债总计	-	-	-	501,985.60	501,985.60
利率敏感度缺口	539,457.42	-	-	32,173,497.07	32,712,954.49
上年度末 2017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	639,503.56	-	-	-	639,503.56
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	138.90	-	-	-	138.90
交易性金融资产	-	-	-	32,588,174.76	32,588,174.76
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	140.69	140.69

应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	639,642.46	-	-32,588,315.45	33,227,957.91
负债				
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	14,971.30	14,971.30
应付托管费	-	-	2,994.26	2,994.26
应付证券清算款	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	3,501.40	3,501.40
应付利息	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	555,000.00	555,000.00
负债总计	-	-	576,466.96	576,466.96
利率敏感度缺口	639,642.46	-	-32,011,848.49	32,651,490.95

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 2018 年 2 月 22 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%。

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。本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股，所面临的其他价格风险来源于标的指数成份股和备选成份股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 2018年2月22日		上年度末 2017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	32,674,750.56	99.88	32,588,174.76	99.81
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	32,674,750.56	99.88	32,588,174.76	99.81

注：无。

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		
	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（2018年2月22日）	上年度末（2017年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	1,618,888.29	1,614,026.06
	业绩比较基准下降 5%	1,618,888.29	1,614,026.06

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：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

无。

§ 7 投资组合报告(转型后)

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	20,430,198.93	82.00
	其中：股票	20,430,198.93	82.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,467,324.15	17.93
8	其他各项资产	18,251.41	0.07
9	合计	24,915,774.49	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	181,397.00	0.74
B	采矿业	391,325.00	1.60
C	制造业	8,612,714.68	35.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	141,742.00	0.58
E	建筑业	740,632.50	3.03
F	批发和零售业	691,536.00	2.83
G	交通运输、仓储和邮政业	440,294.00	1.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,088,520.75	4.46
J	金融业	6,034,286.00	24.72
K	房地产业	1,077,769.00	4.42
L	租赁和商务服务业	29,784.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	101,964.00	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	368,380.00	1.51
R	文化、体育和娱乐业	529,854.00	2.17
S	综合	-	-
	合计	20,430,198.93	83.69

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	15,900	931,422.00	3.82
2	601288	农业银行	269,700	927,768.00	3.80
3	600016	民生银行	130,900	916,300.00	3.75
4	601166	兴业银行	61,200	881,280.00	3.61
5	601628	中国人寿	32,200	725,144.00	2.97
6	002594	比亚迪	12,900	615,072.00	2.52
7	600519	贵州茅台	800	585,168.00	2.40
8	000423	东阿阿胶	10,800	581,148.00	2.38
9	300072	三聚环保	24,350	566,868.00	2.32
10	000725	京东方A	136,280	482,431.20	1.98
11	300426	唐德影视	38,900	480,415.00	1.97
12	002460	赣锋锂业	10,800	416,664.00	1.71
13	601688	华泰证券	27,800	416,166.00	1.70
14	000776	广发证券	30,900	410,043.00	1.68
15	000651	格力电器	8,600	405,490.00	1.66
16	600837	海通证券	42,500	402,475.00	1.65
17	601633	长城汽车	39,800	390,836.00	1.60
18	002146	荣盛发展	44,600	389,358.00	1.59
19	002044	美年健康	16,300	368,380.00	1.51
20	600340	华夏幸福	14,300	368,225.00	1.51
21	601211	国泰君安	24,200	356,708.00	1.46
22	600309	万华化学	7,836	355,911.12	1.46
23	600703	三安光电	17,700	340,194.00	1.39
24	600153	建发股份	37,800	339,822.00	1.39
25	000333	美的集团	6,500	339,430.00	1.39
26	601021	春秋航空	9,600	336,288.00	1.38
27	000623	吉林敖东	18,468	332,054.64	1.36

28	600570	恒生电子	5,700	301,815.00	1.24
29	601800	中国交建	22,000	250,580.00	1.03
30	000858	五粮液	3,200	243,200.00	1.00
31	601898	中煤能源	50,100	241,983.00	0.99
32	603858	步长制药	5,600	239,624.00	0.98
33	000425	徐工机械	47,400	200,976.00	0.82
34	600050	中国联通	39,200	192,864.00	0.79
35	002241	歌尔股份	18,700	190,553.00	0.78
36	300098	高新兴	23,443	187,075.14	0.77
37	600372	中航电子	14,200	185,452.00	0.76
38	600739	辽宁成大	12,100	183,678.00	0.75
39	000157	中联重科	44,600	183,306.00	0.75
40	300170	汉得信息	11,200	181,888.00	0.75
41	002601	龙蟠佰利	13,900	179,727.00	0.74
42	601186	中国铁建	20,800	179,296.00	0.73
43	300033	同花顺	4,300	167,141.00	0.68
44	300197	铁汉生态	29,850	160,294.50	0.66
45	300134	大富科技	17,500	156,450.00	0.64
46	002299	圣农发展	10,100	156,449.00	0.64
47	600782	新钢股份	27,600	154,008.00	0.63
48	600157	永泰能源	83,900	149,342.00	0.61
49	002304	洋河股份	1,100	144,760.00	0.59
50	600795	国电电力	54,100	141,742.00	0.58
51	601155	新城控股	4,400	136,268.00	0.56
52	000671	阳光城	22,300	133,131.00	0.55
53	600887	伊利股份	4,600	128,340.00	0.53
54	600827	百联股份	12,100	123,420.00	0.51
55	600690	青岛海尔	6,300	121,338.00	0.50
56	000063	中兴通讯	8,784	114,455.52	0.47
57	000738	航发控制	8,400	111,972.00	0.46
58	601618	中国中冶	33,400	111,222.00	0.46
59	600881	亚泰集团	28,500	106,305.00	0.44
60	000413	东旭光电	17,300	104,838.00	0.43
61	600221	海航控股	32,200	104,006.00	0.43
62	000888	峨眉山A	11,600	101,964.00	0.42
63	002252	上海莱士	4,160	89,315.20	0.37
64	600569	安阳钢铁	21,500	84,710.00	0.35
65	000568	泸州老窖	1,300	79,118.00	0.32
66	000895	双汇发展	2,800	73,948.00	0.30
67	000563	陕国投A	19,700	66,980.00	0.27
68	300017	网宿科技	5,391	57,737.61	0.24
69	000100	TCL 集团	18,700	54,230.00	0.22

70	000540	中天金融	12,150	50,787.00	0.21
71	002739	万达电影	1,300	49,439.00	0.20
72	000488	晨鸣纸业	3,700	47,804.00	0.20
73	000652	泰达股份	14,300	44,616.00	0.18
74	600485	信威集团	4,300	44,032.00	0.18
75	600083	博信股份	2,000	39,940.00	0.16
76	002310	东方园林	3,000	39,240.00	0.16
77	002394	联发股份	3,800	38,494.00	0.16
78	002083	孚日股份	5,900	33,099.00	0.14
79	600522	中天科技	3,600	31,716.00	0.13
80	000415	渤海金控	5,100	29,784.00	0.12
81	002746	仙坛股份	2,200	24,948.00	0.10
82	600597	光明乳业	1,100	10,857.00	0.04
83	002798	帝欧家居	300	8,880.00	0.04

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300124	汇川技术	2,081,265.10	8.53
2	300070	碧水源	1,748,268.00	7.16
3	300072	三聚环保	1,651,145.00	6.76
4	300136	信维通信	1,588,613.96	6.51
5	300024	机器人	1,569,015.00	6.43
6	300059	东方财富	1,290,820.40	5.29
7	601288	农业银行	1,240,408.00	5.08
8	601318	中国平安	1,219,224.00	4.99
9	300274	阳光电源	1,163,882.00	4.77
10	300408	三环集团	1,089,183.00	4.46
11	300017	网宿科技	1,043,741.00	4.28
12	300383	光环新网	986,422.00	4.04
13	300315	掌趣科技	978,669.90	4.01
14	600016	民生银行	976,514.00	4.00
15	300144	宋城演艺	952,983.00	3.90
16	300027	华谊兄弟	946,452.00	3.88
17	601166	兴业银行	940,601.00	3.85
18	300168	万达信息	918,197.20	3.76
19	300418	昆仑万维	895,189.00	3.67
20	300088	长信科技	842,982.00	3.45
21	000423	东阿阿胶	828,734.00	3.39
22	601628	中国人寿	801,302.00	3.28

23	002594	比亚迪	747,613.00	3.06
24	300433	蓝思科技	739,562.00	3.03
25	300251	光线传媒	737,832.00	3.02
26	300355	蒙草生态	718,268.00	2.94
27	300033	同花顺	712,926.00	2.92
28	300170	汉得信息	704,009.78	2.88
29	300055	万邦达	664,033.42	2.72
30	300316	晶盛机电	656,717.00	2.69
31	601633	长城汽车	655,521.00	2.69
32	300287	飞利信	632,834.00	2.59
33	300450	先导智能	629,905.00	2.58
34	000776	广发证券	617,628.00	2.53
35	600519	贵州茅台	610,947.00	2.50
36	300113	顺网科技	602,110.16	2.47
37	002146	荣盛发展	561,198.00	2.30
38	300115	长盈精密	557,940.00	2.29
39	601688	华泰证券	544,265.00	2.23
40	300413	快乐购	533,785.00	2.19
41	300014	亿纬锂能	532,637.00	2.18
42	300426	唐德影视	513,433.00	2.10
43	601800	中国交建	502,504.00	2.06
44	000623	吉林敖东	499,242.80	2.05
45	300496	中科创达	497,045.00	2.04
46	600153	建发股份	496,866.00	2.04
47	300053	欧比特	489,784.00	2.01

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	2,121,454.10	8.69
2	300124	汇川技术	2,114,590.00	8.66
3	300136	信维通信	1,618,083.00	6.63
4	300070	碧水源	1,595,194.00	6.53
5	300024	机器人	1,500,155.00	6.15
6	300059	东方财富	1,297,474.54	5.32
7	300408	三环集团	1,067,084.00	4.37
8	300144	宋城演艺	1,060,075.00	4.34
9	300168	万达信息	934,034.00	3.83
10	600519	贵州茅台	923,903.49	3.78
11	300072	三聚环保	881,148.00	3.61

12	600036	招商银行	840,948.63	3.44
13	300315	掌趣科技	826,725.00	3.39
14	300383	光环新网	825,160.00	3.38
15	300274	阳光电源	791,104.00	3.24
16	300027	华谊兄弟	781,619.79	3.20
17	300418	昆仑万维	778,756.00	3.19
18	300088	长信科技	773,966.00	3.17
19	300017	网宿科技	756,167.00	3.10
20	300251	光线传媒	695,678.40	2.85
21	601288	农业银行	680,724.00	2.79
22	300433	蓝思科技	677,984.00	2.78
23	000651	格力电器	645,585.88	2.64
24	000333	美的集团	640,965.80	2.63
25	601398	工商银行	616,144.60	2.52
26	601166	兴业银行	594,130.60	2.43
27	300450	先导智能	548,847.28	2.25
28	300014	亿纬锂能	546,769.00	2.24
29	300355	蒙草生态	542,193.00	2.22
30	600016	民生银行	540,490.60	2.21
31	300055	万邦达	539,120.00	2.21
32	300287	飞利信	534,705.00	2.19
33	300413	快乐购	533,466.00	2.19
34	300316	晶盛机电	520,486.20	2.13
35	600030	中信证券	517,429.80	2.12
36	300113	顺网科技	506,350.00	2.07
37	300033	同花顺	502,476.00	2.06

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	59,249,110.51
卖出股票收入(成交)总额	64,740,172.32

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:无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	16,299.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,032.89
5	应收申购款	918.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,251.41

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300072	三聚环保	566,868.00	2.32	重大事项

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。

§ 7 投资组合报告(转型前)

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	32,674,750.56	98.37
	其中：股票	32,674,750.56	98.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	539,355.53	1.62
8	其他各项资产	834.00	0.00
9	合计	33,214,940.09	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 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	72,187.20	0.22
B	采矿业	1,070,708.82	3.27
C	制造业	12,759,515.96	39.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	847,481.09	2.59
E	建筑业	1,215,073.83	3.71
F	批发和零售业	639,466.15	1.95
G	交通运输、仓储和邮政业	1,038,076.25	3.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	1,154,523.69	3.53
J	金融业	11,207,438.04	34.26
K	房地产业	1,765,386.27	5.40
L	租赁和商务服务业	411,887.80	1.26
M	科学研究和技术服务 业	-	-
N	水利、环境和公共设施 管理业	119,881.30	0.37
O	居民服务、修理和其他 服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	110,673.00	0.34
R	文化、体育和娱乐业	237,902.16	0.73
S	综合	24,549.00	0.08
	合计	32,674,750.56	99.88

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	30,282	2,112,775.14	6.46
2	600519	贵州茅台	1,321	980,776.45	3.00
3	600036	招商银行	28,799	907,168.50	2.77
4	000651	格力电器	13,458	740,055.42	2.26
5	000333	美的集团	11,705	680,528.70	2.08
6	601166	兴业银行	34,820	631,634.80	1.93
7	600887	伊利股份	17,002	582,318.50	1.78
8	600016	民生银行	66,160	565,668.00	1.73
9	601328	交通银行	76,940	510,881.60	1.56
10	601288	农业银行	107,040	461,342.40	1.41
11	000002	万科A	13,540	456,298.00	1.39
12	000858	五粮液	5,280	422,928.00	1.29
13	601398	工商银行	60,380	422,660.00	1.29
14	002415	海康威视	10,325	417,543.00	1.28
15	600000	浦发银行	32,864	415,072.32	1.27
16	600030	中信证券	21,980	395,859.80	1.21
17	601668	中国建筑	42,020	383,222.40	1.17
18	000725	京东方A	66,380	375,710.80	1.15
19	601601	中国太保	8,720	353,421.60	1.08
20	600276	恒瑞医药	4,682	339,304.54	1.04
21	600104	上汽集团	9,760	332,035.20	1.01
22	600048	保利地产	19,847	306,239.21	0.94
23	601169	北京银行	40,837	303,827.28	0.93
24	000001	平安银行	23,990	298,915.40	0.91
25	600900	长江电力	18,401	296,440.11	0.91
26	600837	海通证券	22,589	272,875.12	0.83
27	601988	中国银行	59,007	257,860.59	0.79
28	600019	宝钢股份	24,744	257,832.48	0.79
29	601766	中国中车	20,376	210,484.08	0.64
30	002304	洋河股份	1,600	210,080.00	0.64
31	000063	中兴通讯	6,584	205,552.48	0.63
32	002027	分众传媒	13,700	197,554.00	0.60
33	601818	光大银行	44,540	196,421.40	0.60

34	600028	中国石化	29,423	190,661.04	0.58
35	600585	海螺水泥	5,560	186,204.40	0.57
36	601211	国泰君安	10,500	184,905.00	0.57
37	600518	康美药业	8,280	175,453.20	0.54
38	600690	青岛海尔	8,500	173,485.00	0.53
39	600015	华夏银行	17,907	169,042.08	0.52
40	600703	三安光电	6,788	164,880.52	0.50
41	601939	建设银行	18,740	164,537.20	0.50
42	600050	中国联通	25,401	158,756.25	0.49
43	601688	华泰证券	9,140	155,562.80	0.48
44	601006	大秦铁路	16,620	154,898.40	0.47
45	001979	招商蛇口	6,563	152,983.53	0.47
46	601600	中国铝业	18,806	152,140.54	0.47
47	002594	比亚迪	2,440	152,060.80	0.46
48	601857	中国石油	18,123	147,883.68	0.45
49	601989	中国重工	26,600	146,832.00	0.45
50	600919	江苏银行	19,400	145,888.00	0.45
51	002142	宁波银行	7,023	145,235.64	0.44
52	601888	中国国旅	2,700	144,369.00	0.44
53	600309	万华化学	3,936	143,427.84	0.44
54	002230	科大讯飞	2,655	142,573.50	0.44
55	601088	中国神华	5,525	140,169.25	0.43
56	601899	紫金矿业	29,032	138,482.64	0.42
57	000538	云南白药	1,437	138,239.40	0.42
58	000776	广发证券	8,255	135,629.65	0.41
59	601186	中国铁建	12,824	134,523.76	0.41
60	601012	隆基股份	3,900	132,483.00	0.40
61	601009	南京银行	14,231	132,063.68	0.40
62	002236	大华股份	4,800	129,120.00	0.39
63	601336	新华保险	2,320	126,625.60	0.39
64	002024	苏宁易购	10,335	126,293.70	0.39
65	601628	中国人寿	4,620	125,386.80	0.38
66	000568	泸州老窖	2,000	124,800.00	0.38
67	600340	华夏幸福	3,300	124,773.00	0.38
68	600009	上海机场	2,670	124,502.10	0.38
69	600029	南方航空	9,785	121,138.30	0.37
70	002008	大族激光	2,300	119,347.00	0.36
71	601390	中国中铁	15,622	118,414.76	0.36
72	002450	康得新	5,864	115,989.92	0.35
73	600741	华域汽车	4,320	115,905.60	0.35
74	000338	潍柴动力	13,540	115,902.40	0.35
75	601933	永辉超市	10,720	115,347.20	0.35

76	600958	东方证券	8,700	114,318.00	0.35
77	300059	东方财富	8,364	112,161.24	0.34
78	600196	复星医药	2,740	110,613.80	0.34
79	600031	三一重工	12,814	110,584.82	0.34
80	002456	欧菲科技	5,300	108,968.00	0.33
81	002475	立讯精密	4,375	108,718.75	0.33
82	600999	招商证券	6,380	108,587.60	0.33
83	002466	天齐锂业	1,840	108,247.20	0.33
84	600221	海航控股	32,200	104,650.00	0.32
85	600660	福耀玻璃	3,860	103,795.40	0.32
86	601225	陕西煤业	11,200	101,808.00	0.31
87	600795	国电电力	33,020	99,060.00	0.30
88	002460	赣锋锂业	1,400	95,522.00	0.29
89	601985	中国核电	13,000	93,600.00	0.29
90	002202	金风科技	5,624	92,402.32	0.28
91	601669	中国电建	12,840	91,934.40	0.28
92	600089	特变电工	10,321	91,650.48	0.28
93	000423	东阿阿胶	1,462	91,448.10	0.28
94	000413	东旭光电	11,300	90,400.00	0.28
95	600010	宝钢股份	38,245	90,258.20	0.28
96	600066	宇通客车	3,700	88,800.00	0.27
97	600115	东方航空	10,974	88,011.48	0.27
98	603799	华友钴业	800	87,992.00	0.27
99	601377	兴业证券	12,956	87,712.12	0.27
100	601155	新城控股	2,500	85,550.00	0.26
101	000166	申万宏源	16,795	83,807.05	0.26
102	000100	TCL 集团	23,880	82,863.60	0.25
103	600383	金地集团	6,294	81,507.30	0.25
104	002252	上海莱士	4,160	81,286.40	0.25
105	300070	碧水源	5,189	80,429.50	0.25
106	000069	华侨城 A	9,120	79,617.60	0.24
107	300072	三聚环保	2,450	79,502.50	0.24
108	300124	汇川技术	2,700	79,380.00	0.24
109	000783	长江证券	10,820	79,202.40	0.24
110	600352	浙江龙盛	6,320	79,000.00	0.24
111	600606	绿地控股	10,200	78,438.00	0.24
112	300003	乐普医疗	2,900	78,358.00	0.24
113	300136	信维通信	2,200	77,462.00	0.24
114	600111	北方稀土	6,021	77,309.64	0.24
115	601111	中国国航	5,580	77,115.60	0.24
116	600886	国投电力	11,320	76,862.80	0.23
117	000963	华东医药	1,336	76,820.00	0.23

118	000895	双汇发展	2,770	76,285.80	0.23
119	002241	歌尔股份	5,442	75,480.54	0.23
120	601901	方正证券	11,500	73,255.00	0.22
121	600522	中天科技	6,000	72,180.00	0.22
122	002736	国信证券	6,800	72,012.00	0.22
123	600011	华能国际	11,700	70,551.00	0.22
124	601788	光大证券	5,400	70,038.00	0.21
125	601607	上海医药	3,140	69,111.40	0.21
126	002739	万达电影	1,300	67,652.00	0.21
127	600705	中航资本	12,500	67,000.00	0.20
128	600068	葛洲坝	7,675	66,619.00	0.20
129	002508	老板电器	1,300	66,001.00	0.20
130	002310	东方园林	3,700	65,083.00	0.20
131	600406	国电南瑞	4,015	65,043.00	0.20
132	601919	中远海控	10,600	64,448.00	0.20
133	002044	美年健康	2,900	64,380.00	0.20
134	000625	长安汽车	5,380	63,968.20	0.20
135	600023	浙能电力	11,340	63,277.20	0.19
136	600816	安信信托	5,080	62,738.00	0.19
137	600485	信威集团	4,300	62,737.00	0.19
138	000503	国新健康	2,000	62,600.00	0.19
139	002081	金螳螂	4,361	62,275.08	0.19
140	600535	天士力	1,778	61,003.18	0.19
141	600177	雅戈尔	6,988	60,865.48	0.19
142	601998	中信银行	8,520	60,577.20	0.19
143	600018	上港集团	8,400	60,564.00	0.19
144	601618	中国中冶	14,433	60,185.61	0.18
145	600570	恒生电子	1,300	59,787.00	0.18
146	600739	辽宁成大	3,400	59,704.00	0.18
147	600271	航天信息	3,040	59,644.80	0.18
148	000540	中天金融	8,100	59,535.00	0.18
149	600436	片仔癀	800	58,712.00	0.18
150	600588	用友网络	1,956	58,562.64	0.18
151	601997	贵阳银行	3,800	58,254.00	0.18
152	600482	中国动力	2,400	57,672.00	0.18
153	601018	宁波港	11,045	57,544.45	0.18
154	000839	中信国安	7,600	57,152.00	0.17
155	601727	上海电气	9,800	56,840.00	0.17
156	002146	荣盛发展	4,870	56,589.40	0.17
157	600893	航发动力	2,440	56,534.80	0.17
158	601099	太平洋	18,515	56,470.75	0.17
159	601555	东吴证券	6,720	56,380.80	0.17

160	002572	索菲亚	1,500	56,250.00	0.17
161	600674	川投能源	6,166	55,678.98	0.17
162	002558	巨人网络	1,700	54,961.00	0.17
163	600637	东方明珠	3,604	54,924.96	0.17
164	603993	洛阳钼业	7,351	54,470.91	0.17
165	600547	山东黄金	2,040	53,876.40	0.16
166	601800	中国交建	4,240	53,848.00	0.16
167	600362	江西铜业	2,870	53,582.90	0.16
168	000623	吉林敖东	2,574	53,256.06	0.16
169	600219	南山铝业	15,500	52,390.00	0.16
170	000157	中联重科	12,199	52,211.72	0.16
171	600208	新湖中宝	12,000	51,960.00	0.16
172	300024	机器人	2,980	51,792.40	0.16
173	000768	中航飞机	3,840	51,532.80	0.16
174	000728	国元证券	5,618	51,404.70	0.16
175	002673	西部证券	4,816	50,230.88	0.15
176	600153	建发股份	3,914	50,020.92	0.15
177	600804	鹏博士	3,960	49,579.20	0.15
178	000425	徐工机械	11,756	49,257.64	0.15
179	600150	*ST 船舶	1,991	49,117.97	0.15
180	000630	铜陵有色	17,625	48,997.50	0.15
181	601992	金隅集团	9,300	48,732.00	0.15
182	600109	国金证券	5,870	48,603.60	0.15
183	002797	第一创业	5,820	48,597.00	0.15
184	000792	盐湖股份	3,840	48,576.00	0.15
185	600100	同方股份	4,940	48,412.00	0.15
186	600157	永泰能源	14,209	47,742.24	0.15
187	600170	上海建工	12,458	47,215.82	0.14
188	600085	同仁堂	1,440	47,116.80	0.14
189	002714	牧原股份	900	47,088.00	0.14
190	000709	河钢股份	11,812	46,657.40	0.14
191	000060	中金岭南	4,577	46,456.55	0.14
192	300015	爱尔眼科	1,300	46,293.00	0.14
193	300017	网宿科技	3,991	45,098.30	0.14
194	000876	新希望	5,900	44,840.00	0.14
195	601216	君正集团	9,440	44,462.40	0.14
196	002294	信立泰	1,100	43,791.00	0.13
197	300027	华谊兄弟	4,652	43,635.76	0.13
198	600682	南京新百	1,300	43,264.00	0.13
199	601333	广深铁路	9,482	43,237.92	0.13
200	002465	海格通信	4,500	43,065.00	0.13
201	600297	广汇汽车	5,940	42,055.20	0.13

202	600489	中金黄金	4,796	41,917.04	0.13
203	600332	白云山	1,640	41,229.60	0.13
204	000983	西山煤电	4,400	41,096.00	0.13
205	002065	东华软件	5,200	40,768.00	0.12
206	600498	烽火通信	1,500	40,305.00	0.12
207	600415	小商品城	7,610	40,180.80	0.12
208	601198	东兴证券	3,000	40,170.00	0.12
209	600583	海油工程	6,140	40,032.80	0.12
210	601633	长城汽车	3,300	39,501.00	0.12
211	000826	启迪桑德	1,410	39,451.80	0.12
212	600820	隧道股份	5,200	39,052.00	0.12
213	300315	掌趣科技	6,100	38,308.00	0.12
214	300144	宋城演艺	2,000	38,120.00	0.12
215	000671	阳光城	4,500	37,980.00	0.12
216	002007	华兰生物	1,475	37,789.50	0.12
217	000008	神州高铁	4,700	37,694.00	0.12
218	000898	鞍钢股份	5,100	37,587.00	0.11
219	601229	上海银行	2,370	37,469.70	0.11
220	002074	国轩高科	1,850	37,333.00	0.11
221	601117	中国化学	5,500	37,125.00	0.11
222	600663	陆家嘴	1,960	37,063.60	0.11
223	000750	国海证券	8,192	37,027.84	0.11
224	600666	奥瑞德	2,080	36,192.00	0.11
225	300122	智飞生物	1,300	36,153.00	0.11
226	000961	中南建设	5,100	35,445.00	0.11
227	002385	大北农	5,700	35,226.00	0.11
228	600369	西南证券	7,840	35,044.80	0.11
229	002470	金正大	4,500	34,515.00	0.11
230	002500	山西证券	4,740	34,507.20	0.11
231	600977	中国电影	2,000	34,240.00	0.10
232	000402	金融街	3,280	33,718.40	0.10
233	000559	万向钱潮	3,856	33,624.32	0.10
234	002624	完美世界	1,100	33,451.00	0.10
235	600376	首开股份	3,600	32,904.00	0.10
236	600008	首创股份	6,700	32,629.00	0.10
237	600959	江苏有线	4,340	32,072.60	0.10
238	002426	胜利精密	5,700	31,635.00	0.10
239	600704	物产中大	4,735	31,393.05	0.10
240	300251	光线传媒	2,460	31,094.40	0.10
241	600118	中国卫星	1,580	31,078.60	0.10
242	000686	东北证券	3,920	30,968.00	0.09
243	002601	龙鳞佰利	1,700	30,889.00	0.09

244	000627	天茂集团	4,100	30,012.00	0.09
245	000415	渤海金控	5,100	29,784.00	0.09
246	600649	城投控股	3,475	29,363.75	0.09
247	601991	大唐发电	7,800	29,250.00	0.09
248	600549	厦门钨业	1,200	28,788.00	0.09
249	601877	正泰电器	1,200	28,776.00	0.09
250	300033	同花顺	600	28,710.00	0.09
251	002352	顺丰控股	600	28,680.00	0.09
252	600061	国投资本	2,300	27,991.00	0.09
253	601866	中远海发	8,820	27,783.00	0.08
254	002602	世纪华通	800	26,144.00	0.08
255	600827	百联股份	2,187	25,456.68	0.08
256	601898	中煤能源	4,600	25,438.00	0.08
257	601118	海南橡胶	4,320	25,099.20	0.08
258	601966	玲珑轮胎	1,300	24,713.00	0.08
259	000959	首钢股份	4,400	24,684.00	0.08
260	600895	张江高科	2,100	24,549.00	0.08
261	600688	上海石化	4,100	24,231.00	0.07
262	600685	中船防务	900	23,994.00	0.07
263	000938	紫光股份	400	23,752.00	0.07
264	600373	中文传媒	1,500	23,160.00	0.07
265	002153	石基信息	800	21,888.00	0.07
266	600909	华安证券	3,000	21,870.00	0.07
267	600038	中直股份	600	21,444.00	0.07
268	601872	招商轮船	5,400	21,330.00	0.07
269	601021	春秋航空	600	21,120.00	0.06
270	000723	美锦能源	3,400	21,046.00	0.06
271	002174	游族网络	1,000	20,910.00	0.06
272	601611	中国核建	2,200	20,130.00	0.06
273	002411	必康股份	800	19,264.00	0.06
274	002468	申通快递	800	18,904.00	0.06
275	601958	金钼股份	2,669	18,362.72	0.06
276	601718	际华集团	3,600	18,324.00	0.06
277	601881	中国银河	1,800	18,036.00	0.06
278	600188	兖州煤业	1,043	17,418.10	0.05
279	002555	三七互娱	900	17,217.00	0.05
280	601608	中信重工	4,800	16,656.00	0.05
281	600372	中航电子	1,390	16,402.00	0.05
282	002608	江苏国信	1,800	15,948.00	0.05
283	002292	奥飞娱乐	1,400	15,806.00	0.05
284	000738	航发控制	1,200	14,328.00	0.04
285	600021	上海电力	1,800	14,184.00	0.04

286	002424	贵州百灵	1,100	13,783.00	0.04
287	601375	中原证券	2,200	13,662.00	0.04
288	600233	圆通速递	900	13,329.00	0.04
289	601878	浙商证券	1,000	13,130.00	0.04
290	600926	杭州银行	1,100	13,024.00	0.04
291	601212	白银有色	2,100	12,180.00	0.04
292	600871	*ST 油服	5,000	11,350.00	0.03
293	601163	三角轮胎	600	10,872.00	0.03
294	601228	广州港	2,000	10,820.00	0.03
295	603858	步长制药	200	10,158.00	0.03
296	600390	五矿资本	900	9,486.00	0.03
297	603160	汇顶科技	100	7,996.00	0.02
298	002841	视源股份	100	6,647.00	0.02
299	002831	裕同科技	100	5,234.00	0.02
300	002839	张家港行	500	4,590.00	0.01

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

注:无。

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

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	000333	美的集团	58,700.00	0.18
2	300104	乐视网	32,653.00	0.10
3	600074	*ST 保千	8,456.00	0.03

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	-
卖出股票收入(成交)总额	99,809.00

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:无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	101.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	732.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	834.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300072	三聚环保	566,868.00	2.32	重大事项

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(转型后)

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
147	212,674.16	8,163,224.19	26.11	23,099,876.88	73.89

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注:截止本报告期末,本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

8.3 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。

§ 8 基金份额持有人信息(转型前)

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
394	83,027.80	9,663,033.68	29.54	23,049,920.80	70.46

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-道冲补天1号私募 基金	2,044,282.00	24.95
2	张杰	610,000.00	7.45
3	张洪琴	478,704.00	5.84
4	赵何鉴	250,000.00	3.05
5	中外建工程设计与顾问 有限公司	231,646.00	2.83
6	葛惠瑾	218,945.00	2.67

7	刘宇峰	190,555.00	2.33
8	钱中明	161,800.00	1.98
9	刘义	142,566.00	1.74
10	余景妍	140,000.00	1.71

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截止本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2018年2月23日） 基金份额总额	32,712,954.48
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	22,760,510.65
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	24,210,364.06
基金合同生效日起至报告期期末基金 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	31,263,101.07

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。

§ 9 开放式基金份额变动（转型前）

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）	24,520,786.48
本报告期期末基金份额总额	32,712,954.48

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

自 2017 年 12 月 7 日至 2018 年 1 月 7 日，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”）的份额持有人大会以通讯方式召开。本基金基金份额持有人大会于 2018 年 1 月 8 日表决通过了《关于鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。

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：基金管理人本报告期内无重大人事变动。

基金托管人的重大人事变动：基金托管人的专门基金托管部门本报告期内无重大人事变动。

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

鹏华沪深 300ETF 由指数基金转型为主动量化投资基金。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金审计的会计师事务所。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(转型后)

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	63,731,220.02	51.40%	58,078.48	51.84%	
华创证券	1	40,263,87	32.47%	36,692.78	32.75%	

		7.37				
东方财富 证券	2	9,526,547 .63	7.68%	7,728.81	6.90%	本报告 期新增 1个
广发证券	2	7,895,787 .53	6.37%	7,195.44	6.42%	-
方正证券	2	2,571,850 .28	2.07%	2,343.78	2.09%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	本报告 期新增
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-

中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	本报告 期新增
长江证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	629,256.00	50.36%	-	-	-	-
华创证券	-	-	78,800,000.00	100.00%	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	620,376.00	49.64%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	91,353.00	91.53%	83.24	91.52%	-
华创证券	1	8,456.00	8.47%	7.71	8.48%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-

方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	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。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债 券 成交总额 的比例	成交金额	占当期债券 回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

注:无。

10.9 其他重大事件(转型后)

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
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》	2018年3月24日
8	鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018年3月28日
9	鹏华量化先锋混合型证券投资基金开放申购、赎回和转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018年4月4日
10	鹏华基金管理有限公司关于增加中国建设银行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》	2018年4月4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》	2018年4月11日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下基	《中国证券报》、《上	2018年4月14日

	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》	
13	鹏华基金管理有限公司关于鹏华量化先锋混合型证券投资基金增加销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 4 月 16 日
14	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》	2018 年 4 月 18 日
15	2018 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 4 月 21 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》	2018 年 4 月 24 日
17	鹏华基金管理有限公司关于增加上海基煜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》	2018 年 4 月 27 日
18	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低转换份额和账户最低余额限制的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 5 月 9 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》	2018 年 5 月 9 日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银河证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 5 月 21 日
21	鹏华基金管理有限公司关于提请投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 5 月 28 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》	2018 年 5 月 29 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》	2018 年 5 月 31 日
24	鹏华基金管理有限公司关于提请非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 6 月 1 日
25	鹏华基金关于调整旗下部分基金单笔最低定投金额限制的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 6 月 8 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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 6 月 12 日

	的提示性公告	报》	
27	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票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》	2018 年 6 月 15 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》	2018 年 6 月 16 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》	2018 年 6 月 20 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》	2018 年 6 月 22 日
31	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票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》	2018 年 6 月 22 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》	2018 年 6 月 27 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》	2018 年 6 月 28 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》	2018 年 6 月 29 日
1	鹏华量化先锋混合型证券投资基金的基金份额“确权”登记指引	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 2 月 6 日
2	鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同摘要及招募说明书	中国证券报	2018 年 2 月 23 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》	2018 年 3 月 2 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》	2018 年 3 月 10 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》	2018 年 3 月 21 日
6	关于鹏华旗下 139 只基金修改基金合同的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 3 月 23 日

注:无。

10.10 其他重大事件(转型前)

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鹏华沪深300 交易型开放式指数证券投资基金停牌提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 01 月 08 日
2	鹏华基金管理有限公司关于鹏华沪深300 交易型开放式指数证券投资基金实施转型的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 01 月 09 日
3	鹏华基金管理有限公司关于鹏华沪深300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 01 月 09 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》	2018 年 01 月 17 日
5	2017 年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 01 月 22 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》	2018 年 01 月 24 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海华信证券有限责任公司开展基金转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 01 月 30 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》	2018 年 02 月 02 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》	2018 年 02 月 03 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》	2018 年 02 月 06 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》	2018 年 02 月 07 日
12	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》	2018 年 02 月 08 日
13	鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金终止上市公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 02 月 09 日
14	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》	2018 年 02 月 10 日
15	鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券	《中国证券报》、《上海	2018 年 02 月 12 日

	投资基金份额折算和变更登记的公告	证券报》、《证券时报》	
16	鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金终止上市提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 02 月 13 日
17	鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金份额折算和变更登记结果公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 02 月 24 日
18	2017 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 03 月 29 日

注:无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息（转型后）

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20180223~20180514, 20180523~20180630	8,163,224.19	-	-	8,163,224.19	26.11
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注:1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、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。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息（转型前）

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20180101~20180222	2,004,783.00	6,158,742.19	301.00	8,163,224.19	24.95
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 2018 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.cn>）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

2018 年 08 月 27 日