

# 鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资 基金 2019 年第 1 季度报告

2019 年 03 月 31 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

报告送出日期：2019 年 04 月 19 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 4 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华证券分级
场内简称	券商指基
基金主代码	160633
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 05 月 06 日
报告期末基金份额总额	702,058,548.93 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不

	足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。本基金力争鹏华证券份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。		
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。		
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		
下属分级基金的基金简称	券商指基	券商 A 级	券商 B 级
下属分级基金的场内简称	券商指基	券商 A 级	券商 B 级
下属分级基金的交易代码	160633	150235	150236
下属分级基金的前端交易代码	-	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	640,528,800.93 份	30,764,874.00 份	30,764,874.00 份
下属分级基金的风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。</p> <p>同时本基金为指数基</p>	<p>鹏华证券 A 份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相</p>	<p>鹏华证券 B 份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相</p>

注：无。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019年01月01日 - 2019年03月31日)
1. 本期已实现收益	18,689,607.86
2. 本期利润	194,346,132.76
3. 加权平均基金份额本期利润	0.3951
4. 期末基金资产净值	715,434,690.24
5. 期末基金份额净值	1.019

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。

#### 3.2 基金净值表现

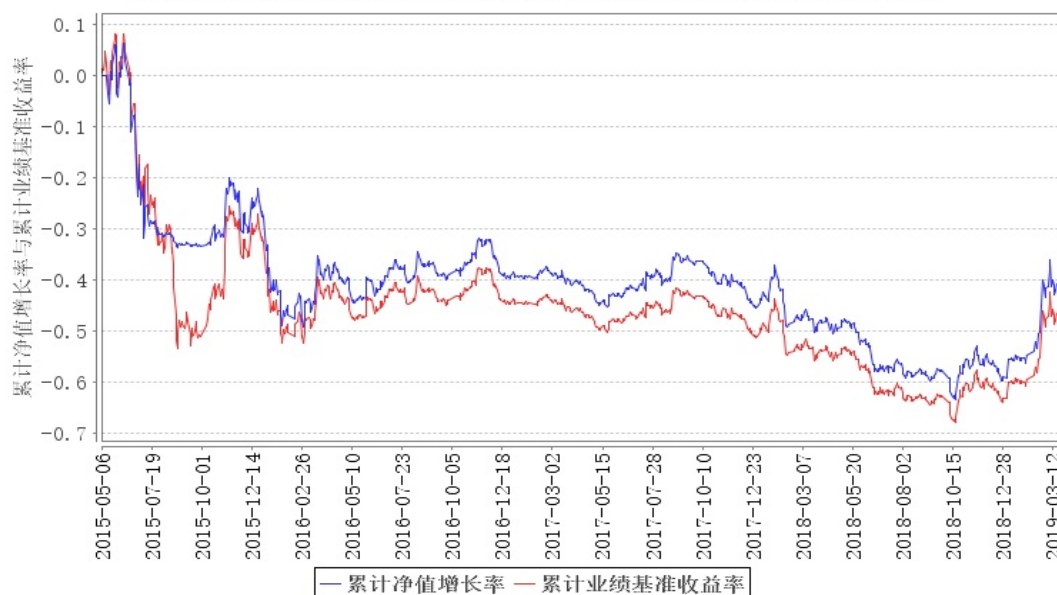
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	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
过去三个月	46.02%	2.96%	46.23%	2.96%	-0.21%	0.00%

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

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2015 年 05 月 06 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
余斌	本基金基金经理	2015-05-06	2019-03-19	12 年	余斌先生，国籍中国，经济学硕士，12 年证券基金从业经验。曾任职于招商证券股份有限公司，担任风险控制部市场风险分析师；2009 年 10 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任机构理财部大客户

				<p>经理、量化投资部量化研究员，先后从事特定客户资产管理业务产品设计、量化研究等工作，现任量化投资部量化业务副总监、基金经理。</p> <p>2014 年 05 月至 2019 年 03 月担任鹏华信息分级基金基金经理，2014 年 05 月至 2019 年 03 月担任鹏华证券保险分级基金基金经理，2014 年 11 月至 2019 年 03 月担任鹏华国防分级基金基金经理，2015 年 04 月至 2019 年 03 月担任鹏华酒分级基金基金经理，2015 年 05 月至 2019 年 03 月担任鹏华证券分级基金基金经理，2015 年 06 月至</p>
--	--	--	--	--

					<p>2019 年 03 月担任鹏华环保分级基金基金经理，2017 年 06 月至 2019 年 03 月担任鹏华空天一体军工指数（LOF）基金基金经理，2017 年 06 月至 2019 年 03 月担任鹏华量化策略混合基金基金经理，2018 年 04 月担任鹏华地产分级基金基金经理。余斌先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，增聘陈龙为本基金基金经理，余斌不再担任本基金基金经理。</p>
陈龙	本基金基金经理	2019-03-19	-	10 年	<p>陈龙先生，国籍中国，经济学硕士，10 年证券基金从业经验。曾任杭州衡泰软件公司金融工程师，2009 年 12 月加盟鹏</p>

					<p>华基金管理 有限公司， 历任监察稽 核部金融工 程总监助理、 量化及衍生 品投资部量 化研究总监 助理，先后 从事金融工 程、量化研 究等工作， 现任量化及 衍生品投资 部量化研究 副总监、基 金经理。 2015 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏 华钢铁分级 基金基金经 理，2016 年 07 月至 2018 年 04 月担任鹏 华创业板分 级基金基金 经理， 2016 年 09 月至 2018 年 04 月担任鹏 华地产分级 基金基金经 理，2016 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏 华香港中小 企业指数 (LOF) 基金 基金经理， 2016 年</p>
--	--	--	--	--	---



					<p>10 月至 2018 年 04 月担任鹏华互联网分级基金基金经理，</p> <p>2019 年 03 月担任鹏华国防分级基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华空天一体军工指数（LOF）基金基金经理，</p> <p>2019 年 03 月担任鹏华证券分级基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华证券保险分级基金基金经理。陈龙先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，增聘陈龙为本基金基金经理，余斌不再担任本基金基金经理。</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 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年 1 季度，A 股市场呈现单边上涨格局。报告期内上证指数上涨 23.93%，深证成指上涨 36.84%，本基金跟踪的中证证券公司指数上涨 48.97%。

本基金秉承指数基金的投资策略，力争跟踪指数的收益，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，组合净值增长率 46.02%，业绩比较基准增长率 46.23%，组合年化跟踪误差为 1.56%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	679,357,716.58	93.18
	其中：股票	679,357,716.58	93.18
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	41,995,151.21	5.76
8	其他资产	7,726,819.20	1.06
9	合计	729,079,686.99	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	678,847,929.17	94.89
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	678,847,929.17	94.89

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	342,541.47	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,902.94	0.00
J	金融业	134,343.00	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	509,787.41	0.07

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

#### 5.3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	4,322,643	107,115,093.54	14.97
2	600837	海通证券	4,848,545	68,025,086.35	9.51
3	601211	国泰君安	2,702,068	54,446,670.20	7.61
4	601688	华泰证券	1,957,037	43,857,199.17	6.13
5	600999	招商证券	1,713,335	30,017,629.20	4.20
6	000776	广发证券	1,773,407	28,675,991.19	4.01
7	600958	东方证券	2,144,990	25,568,280.80	3.57
8	000166	申万宏源	4,050,906	22,361,001.12	3.13
9	601377	兴业证券	2,808,710	20,363,147.50	2.85

10	002736	国信证券	1,473,960	19,957,418.40	2.79
----	--------	------	-----------	---------------	------

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

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	002958	青农商行	17,700	134,343.00	0.02
2	300762	上海瀚讯	1,233	82,475.37	0.01
3	300765	新诺威	1,412	74,821.88	0.01
4	603379	三美股份	2,052	66,546.36	0.01
5	002951	金时科技	1,675	57,653.50	0.01

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

### 5.5 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债券投资明细

注：无。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：无。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

注：无。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 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。

#### 5.10.2 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。

#### 5.10.3 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。

### 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

#### 广发证券

广发证券本次公告原因是广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”或“公司”）处于非公开发行处于审核阶段，根据中国证券监督管理委员会出具的《中国证监会行政许可项目审查一次反馈意见通知书》（181351 号）的要求，说明公司及其子公司最近五年被证券监管部门和交易所采取处罚或监管措施以及整改情况；以及收到广东证监局《关于对广发证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》。具体情况说明如下。

（一）公司及其子公司最近一年被证券监管部门和交易所采取处罚或监管措施以及整改情况：

1、2018 年 9 月 5 日，广东证监局向广发合信产业投资管理有限公司（以下简称“广发合信”）出具了《关于对广发合信产业投资管理有限公司采取责令改正措施的决定》（[2018]53 号），指出广发合信存在以下问题：（1）部分基金产品在募集说明书或基金合同中约定预期收益率或业绩基准收益率，并按照约定的收益率向投资者支付收益；（2）作为楚发一号私募专项投资基金的基金管理人，未采取问卷调查等方式，对投资者的风险识别能力和风险承担能力进行评估；3）2018 年 3 月变更合规风控负责人后，未及时向中国证券投资基金业协会报告，而对广发合信采取责令改正的行政监管措施。整改措施：对此，广发合信高度重视，由公司高管牵头，组织全体员工对函件所反映的问题进行积极整改，措施如下：（1）修改相关基金产品《募集说明书》，删除关于预期收益率或业绩比较基准的表述，并获得所有投资者的确认；（2）与相关基金产品投资者沟通，明确上述结构化基金产品在存续期内不提高杠杆倍数、不增加净申购规模，合同到期后予以清盘，不进行续期，并积极推进提前减资工作；（3）采取问卷调查方式对相关基金投资者进行了风险识别能力和风险承担能力评估；经评估，该投资者风险承受能力为高风险，与基金的产品风险评级相匹配；（4）合规风控负责人已参加基金从业资格考试，并已取得从业资格，广发合信将尽快完成中国证券投资基金业协会平台的信息变更。广发合信积极协调推进相关整改工作，编制整改方案，并于 2018 年 9 月 28 日向广东证监局报送了《广发合信产业投资管理有限公司整改情况报告》。除以上措施外，广发合信将进一步梳理公司内部工作机制，并完善内控措施，查漏补缺，防微杜渐，确保公司未来的业务合法合规开展。 2、2018 年 9 月 5 日，广东证监局向广发信德智胜投资管理有限公司（以下简称“信德智胜”）出具了《关于对广发信德智胜投资管理有限公司采取责令改正措施的决定》（[2018]54 号），指出信德智胜存在以下问题：（1）部分基金产品在募集说明书或基金合同中约定预期收益率或业绩基准收益率，并按照约定的收益率向投资者支付收益；（2）作为珠海广发信德新三板股权投资基金（有限合伙）和珠海广发信德厚维投资企业（有限合伙）的基金管理人，未采取问卷调查等方式对一名投资者的风险识别能力和风险承担能力进行评估；（3）所管理的珠海横琴金投广发信德厚挚股权投资合伙企业（有限合伙）未对基金进行托管，且未在基金合同中明确保障私募财产安全的制度措施和纠纷解决机制，而对信德智胜采取责令改正的行政监管措施。整改措施：对此，信德智胜管理层高度重视，立即组织了对相关问题的自查和整改，并形成报告及时完成向广东证监局的报备。整改方案如下：（1）资管合同中约定了预期收益率的两项资管产品，在合同中已声明该资管计划为非保本型产品，极端情况下有发生亏损的风险，预期收益率并非对投资者最低收益的保证或承诺。已分别于 2018 年 5 月、6 月完成对此两项资管产品收回本息和清算的工作。信德智胜旗下的其他资管计划严格遵守法律法规，没有出现“预期收益率”的不合规表述；（2）信德智胜立即对投资者采取调查问卷方式对其风险识别能力和风险承担能力进行评估，测试结果为其符合上述两只基金的合格投资者条件；（3）珠海横琴金投广发信德厚挚股权投资合伙企业（有限合伙）为单项目基金，只投资了一个项目，资金募集后随即全部作为投资款完成了投资，因此，该基金从业务运作上不存在对基金托管的需求，发起设立的三方自愿对该合伙企业不进行托管。截至目前，三方也未因未托管而产生任何纠纷。经自查，信德智胜目前管理的其他基金都已经托管。并且，信德智胜加快了该基金投资的项目的退出工作，之后会启动基金清算。信德智胜将严格按照法律的规定成立清算小组，进行财产分配，切实保障基金资金安全和投资人利益；（4）针对决

定书提出的问题，信德智胜承诺：后续发行的任何基金产品，将会严格遵守相关法律规定，不出现任何违规表述，不出现变相承诺本金不受损失或承诺最低收益的行为，对信德智胜销售的私募基金产品均会采取问卷调查等方式对投资者的风险识别能力和风险承担能力进行评估，并由投资者书面承诺符合合格投资者条件；（5）为保护投资人的利益，信德智胜已经建立相应的内部控制指引，已经建立了完善的财产分离制度，私募基金财产与私募基金管理人固有财产之间、不同私募基金财产之间、私募基金财产和其他财产之间实行独立运作，分别核算。综上，信德智胜将会进一步规范自身行为，进一步加强风险管理，同时信德智胜已经建立《投资者适当性管理办法》、《内部控制指引》等相关制度，将会严格遵守相关法律法规以及公司内部制度，维护投资人的合法利益。

3、2018 年 9 月 20 日，广东证监局向瑞元资本管理有限公司（以下简称“瑞元资本”）出具了《关于对瑞元资本管理有限公司采取责令改正措施的决定》（[2018]67 号），指出瑞元资本存在以下问题：（1）公司部分专户产品自成立以来，瑞元资本作为管理人未编制并向资产委托人报送委托财产的投资报告；（2）瑞元资本璟宸股权投资专项资产管理计划为高风险产品，其中一名资产委托人的风险承受能力测评结果为稳健型，瑞元资本未就该产品风险等级超越该委托人风险承受能力的情况要求委托人确认，而对瑞元资本采取责令改正的行政监管措施。整改措施：瑞元资本管理层对广东证监局检查发现的问题高度重视，立即组织开展全面的业务自查，积极协调推进相关整改工作，形成整改报告并于近日完成向广东证监局的报备。整改方案如下：针对投资报告问题拟定了如下整改措施：（1）加强投后管理，新设投后管理部，专门负责公司产品的投后管理和信息披露；（2）自 2018 年第四季度起，瑞元资本将按照资管合同的约定向客户提供投资报告；（3）持续加强信息披露检查力度。针对销售适当性问题拟定了如下整改措施：①建立客户风险测评和产品风险等级匹配系统；②加强客户风险承受能力的有效识别和动态管理；③完善风险匹配不一致情况下产品购买的流程管理和处理措施。除以上措施外，瑞元资本将进一步梳理公司内部工作机制，完善内控措施，查漏补缺，防微杜渐，确保公司未来的业务合法合规开展。同时要求全体人员认真总结，吸取教训，持续开展制度和业务流程的深入学习，强化风险意识、责任意识，促进瑞元资本的稳健发展。

4、2018 年 10 月 17 日，广东证监局向广发期货出具《关于对广发期货有限公司采取责令改正措施的决定》（[2018]77 号），指出广发期货资产管理业务存在第三方投顾或投资经理直接执行投资指令，未经交易员确认的问题，违反了《期货公司监督管理办法》第四十六条的规定。整改措施：对此，广发期货高度重视，由公司高管牵头，组织资产管理部员工对相关问题进行整改，措施如下：（1）修改公司资产管理业务相关制度，明确所有资管产品的投资指令必须经过交易员确认；（2）完善资产管理业务交易系统，调整投资交易指令流程，确保资管计划的投资指令必须经过交易员确认后才能下达到柜台；（3）组织相关人员认真总结，吸取教训，持续开展监管制度和业务流程的学习，强化合规意识，确保公司资产管理业务规范运作。

（二）2019 年 3 月 25 日，公司收到广东证监局《关于对广发证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（广东证监局行政监管措施决定书[2019]20 号），指出公司存在对境外子公司管控不到位，未有效督促境外子公司强化合规风险管理及审慎开展业务等问题，违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条、《证券公司和证券投资基金管理公司境外设立、收购、参股经营机构管理办法》第二十七条的规定；广东证监局依照《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，决定对公司采取责令改正的行政监管措施，公司应于 2019 年 6 月 30 日之前予以改正，并向广东局提交书面整改报告。具体整改措施包括：一是充分履行股东职责，依法参与境外子公司的法人治理，健全对境外子公司的风险管控，形成权责明确、流程清晰、制衡有效的管理机制。二是加强信息系统投入和人员配备，提高合规风控与内部控制管理水平。三是建立健全对境外子公司的稽核审计制度，检查和评估境外子公司内部控制的有效性等。四是严格追究导致境外子公司出现重大风险的相关责任人员责任，并向广东局书面报告问责结果。公司应切实采取措施建立并持续完善覆盖境外机构的合规管理、风险管理和内部控制体系。

东方证券（1）东方证券股份有限公司（以下简称“公司”）的控股子公司东方花旗证券有限公司（以下简称“东方花旗”）于

2018 年 8 月 2 日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《调查通知书》（粤证调查通字 180138 号）。因东方花旗在担任广东广州日报传媒股份有限公司（以下简称“粤传媒”）财务顾问期间涉嫌违反证券法律法规，中国证监会决定对其立案调查，详见公司于 2018 年 8 月 3 日披露的 2018-053 号公告。近日，东方花旗、上述项目主办人郑剑辉和蔡军强收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2018]143 号），主要内容如下：东方花旗在粤传媒收购上海香榭丽传媒股份有限公司（以下简称“香榭丽”）项目中涉嫌未勤勉尽责案，中国证监会已调查完毕，现依法拟作出行政处罚。东方花旗为粤传媒重大资产重组出具的财务顾问报告存在虚假记载。东方花旗作为粤传媒重大资产重组项目的独立财务顾问，在尽职调查过程中未勤勉尽责：未遵守尽职调查制度，未制定尽职调查清单和各主要阶段工作内容；未全面评估粤传媒并购重组活动所涉及的风险；未对上市公司并购重组活动进行充分、广泛、合理的调查，对香榭丽收入及应收账款核查程序缺失；内核机构未对应收账款问题进行核实，仅凭借项目组的回复即通过审核，内核程序流于形式。东方花旗的上述行为违反了《财务顾问管理办法》第十九条第一项、第二十一条第一款、第二十二条第一款、第二十五条之规定，违反了《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）第一百七十三条的规定，构成《上市公司重大资产重组管理办法》（证监会令第 127 号）第五十八条第二款、《财务顾问管理办法》第四十二条以及《证券法》第二百二十三条的情形，项目主办人郑剑辉和蔡军强是直接负责的主管人员。根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据《证券法》第二百二十三条的规定，中国证监会拟决定：一、责令东方花旗改正，没收业务收入 595 万元，并处以 1785 万元罚款；二、对郑剑辉和蔡军强给予警告，并分别处以 10 万元罚款。依据《中华人民共和国行政处罚法》第三十二条、第四十二条和《中国证券监督管理委员会行政处罚听证规则》相关规定，就中国证监会拟实施的行政处罚，东方花旗以及郑剑辉、蔡军强享有陈述、申辩及要求听证的权利。其提出的事实、理由和证据，经中国证监会复核成立的，中国证监会将予以采纳。如果放弃陈述、申辩和要求听证的权利，中国证监会将按照上述事实、理由和依据作出正式的行政处罚。（2）2018 年 11 月 1 日，东方花旗、上述项目主办人郑剑辉和蔡军强收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2018]143 号）（详见公司 2018-068 号公告）。近日，东方花旗以及郑剑辉、蔡军强收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2018]110 号），主要内容如下：依据《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）的有关规定，中国证监会对东方花旗在粤传媒收购上海香榭丽传媒股份有限公司（以下简称“香榭丽”）项目中未勤勉尽责的行为进行了立案调查、审理，并依法向当事人告知了作出行政处罚的事实、理由、依据及当事人依法享有的权利。当事人未提出陈述、申辩意见，也未要求听证。本案现已审理终结。经查明，当事人存在以下违法事实：东方花旗为粤传媒重大资产重组出具的财务顾问报告存在虚假记载。东方花旗作为粤传媒重大资产重组项目的独立财务顾问，在尽职调查过程中未勤勉尽责：未遵守尽职调查制度，未制定尽职调查清单和各主要阶段工作内容；未全面评估粤传媒并购重组活动所涉及的风险；未对上市公司并购重组活动进行充分、广泛、合理的调查，对香榭丽收入及应收账款核查程序缺失；内核机构未对应收账款问题进行核实，仅凭借项目组的回复即通过审核，内核程序流于形式。东方花旗的上述行为违反了《上市公司并购重组财务顾问业务管理办法》（证监会令第 54 号）（以下简称“《财务顾问管理办法》”）第十九条第一项、第二十一条第一款、第二十二条第一款、第二十五条的规定，违反了《证券法》第一百七十三条的规定，构成《上市公司重大资产重组管理办法》（证监会令第 127 号）第五十八条第二款、《财务顾问管理办法》第四十二条以及《证券法》第二百二十三条的情形，项目主办人郑剑辉和蔡军强是直接负责的主管人员。根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据《证券法》第二百二十三条的规定，中国证监会决定：一、责令东方花旗改正，没收业务收入 595 万元，并处以 1785 万元罚款；二、对郑剑辉和蔡军强给予警告，并分别处以 10 万元罚款。东方花旗将在今后开展业务过程中严格遵循勤勉、尽责、审慎、合规的原则，进一步提高规范运作意识，强化内部审核，把控业务质量，全面加强财务顾问业务的管理。东方花旗在此案中涉及的处罚金额预计不会对公司利润造成重大影



响。国信证券（1）国信证券股份有限公司（以下简称“公司”）已于 2018 年 1 月 31 日在深圳证券交易所网站（<http://www.szse.cn>）和指定媒体刊登公告（公告编号：2018-004），因公司保荐业务及财务顾问业务涉嫌违反证券法律法规，中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）决定对公司立案调查。2018 年 5 月 21 日，公司及从事相关业务的人员龙飞虎、王晓娟、张苗、曹仲原收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2018]45 号），主要内容如下：中国证监会已调查完毕，依法拟作出行政处罚。公司出具的《华泽钴镍恢复上市保荐书》、《华泽钴镍重大资产出售及发行股份购买资产暨关联交易之持续督导工作报告书》和《华泽钴镍重大资产出售及发行股份购买资产暨关联交易之 2014 年度持续督导工作报告书》涉嫌虚假记载、重大遗漏。公司在核查上市公司关联方非经营性占用资金和应收票据、以及利用审计专业意见等方面未勤勉尽责。公司本次保荐业务行为，涉嫌违反《中华人民共和国证券法》（以下简称《证券法》）第十一条第二款的规定，构成《证券法》第一百九十二条所述违法情形。龙飞虎、王晓娟是直接负责的主管人员。公司本次并购重组财务顾问业务行为，涉嫌违反《上市公司并购重组财务顾问业务管理办法》第二十二条第一款和《证券法》第一百七十三条的规定，构成《上市公司并购重组财务顾问业务管理办法》第四十二条和《证券法》第二百二十三条所述违法情形。张苗、曹仲原是直接负责的主管人员。依据《证券法》第一百九十二条、第二百二十三条的规定，中国证监会拟决定：一、对于公司保荐业务行为，责令公司改正，给予警告，没收保荐业务收入 100 万元，并处以 300 万元罚款；对龙飞虎、王晓娟给予警告，并分别处以 30 万元罚款。二、对于公司并购重组财务顾问业务行为，责令公司改正，没收并购重组财务顾问业务收入 600 万元，并处以 1,800 万元罚款；对张苗、曹仲原给予警告，并分别处以 30 万元罚款。依据《中华人民共和国行政处罚法》第三十二条、第四十二条和《中国证券监督管理委员会行政处罚听证规则》（证监会令 119 号）等有关规定，就中国证监会拟实施的行政处罚，公司及龙飞虎、王晓娟、张苗、曹仲原享有陈述、申辩和要求听证的权利。公司将在收到正式的处罚决定后及时披露相关信息。（2）2018 年 1 月 30 日，国信证券股份有限公司（以下简称“公司”或“国信证券”）收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《调查通知书》（成稽调查通字[18001]号）。因公司保荐业务及财务顾问业务涉嫌违反证券法律法规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司立案调查。2018 年 5 月 21 日，公司及从事相关业务的人员龙飞虎、王晓娟、张苗、曹仲原收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2018]45 号）。上述事项详见公司于 2018 年 1 月 31 日、5 月 22 日在指定媒体和深圳证券交易所网站（<http://www.szse.cn>）刊登的相关公告。2018 年 6 月 21 日，公司收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2018]46 号），现就主要内容公告如下：依据《中华人民共和国证券法》（以下简称《证券法》）的有关规定，中国证监会依法对国信证券违法违规行为进行了立案调查、审理，并依法向当事人告知了作出行政处罚的事实、理由、依据及当事人依法享有的权利。当事人未提出陈述、申辩意见，也未要求听证。本案现已审理终结。经查明，当事人存在以下违法事实：一、华泽钴镍 2013 年和 2014 年年报存在虚假记载、重大遗漏。二、国信证券出具的《华泽钴镍恢复上市保荐书》、《华泽钴镍重大资产出售及发行股份购买资产暨关联交易之持续督导工作报告书》（以下简称 2013 年度持续督导工作报告书）和《华泽钴镍重大资产出售及发行股份购买资产暨关联交易之 2014 年度持续督导工作报告书》（以下简称 2014 年度持续督导工作报告书）存在虚假记载、重大遗漏。三、国信证券在核查上市公司关联方非经营性占用资金和应收票据，以及利用审计专业意见等方面未勤勉尽责。上述违法事实，有恢复上市保荐书、持续督导工作报告书、相关说明、工作底稿、银行流水、相关票据、相关人员询问笔录等证据证明，足以认定。国信证券本次保荐业务行为，违反《证券法》第十一条第二款的规定，构成《证券法》第一百九十二条所述违法情形。龙飞虎、王晓娟是直接负责的主管人员。国信证券本次并购重组财务顾问业务行为，违反《证券法》第一百七十三条和《上市公司并购重组财务顾问业务管理办法》第二十二条第一款的规定，构成《证券法》第二百二十三条和《上市公司并购重组财务顾问业务管理办法》第四十二条所述违法情形。张苗、曹仲原是直接负责的主管人员。根据当事人违

法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据《证券法》第一百九十二条、第二百二十三条的规定，中国证监会决定：一、对于国信证券保荐业务行为，责令其改正，给予警告，没收保荐业务收入 100 万元，并处以 300 万元罚款；对龙飞虎、王晓娟给予警告，并分别处以 30 万元罚款。二、对于国信证券并购重组财务顾问业务行为，责令其改正，没收并购重组财务顾问业务收入 600 万元，并处以 1,800 万元罚款；对张苗、曹仲原给予警告，并分别处以 10 万元罚款。上述当事人应自收到本处罚决定书之日起 15 日内，将罚没款汇交中国证券监督管理委员会（财政汇缴专户），开户银行：中信银行总行营业部，账号 7111010189800000162，由该行直接上缴国库。当事人还应将注有其名称的付款凭证复印件送中国证券监督管理委员会稽查局备案。当事人如果对本处罚决定不服，可在收到本处罚决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会申请行政复议，也可以在收到本处罚决定书之日起 6 个月内直接向有管辖权的人民法院提起行政诉讼。复议和诉讼期间，上述决定不停止执行。

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

### 5.11.2

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	145,441.74
2	应收证券清算款	2,993,878.94
3	应收股利	-
4	应收利息	9,841.43
5	应收申购款	4,577,657.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,726,819.20

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

### 5.11.5 报告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。

### 5.11.6 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603379	三美股份	66,546.36	0.01	新股未上市

### 5.11.7 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	券商指基	券商 A 级	券商 B 级
报告期期初基金份额总额	368,376,016.72	27,837,166.00	27,837,166.00
报告期期间基金总申购份额	506,123,362.57	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	421,180,448.58	-	-
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	187,209,870.22	2,927,708.00	2,927,708.00
报告期期末基金份额总额	640,528,800.93	30,764,874.00	30,764,874.00

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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	20190101~20190225	86,362,459.39	-	86,362,459.39	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p>							

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。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金 2019 年第 1 季度报告》（原文）。

### 9.2 存放地点

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

### 9.3 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  
2019 年 04 月 19 日