

# 鹏华动力增长混合型证券投资基金（LOF） 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 23 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至06月30日。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
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	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	38
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	39

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	39
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	39
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	39
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12	投资组合报告附注	39
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>41</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2	期末上市基金前十名持有人	41
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	41
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>41</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>42</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4	基金投资策略的改变	42
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8	其他重大事件	45
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>48</b>
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	48
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	49
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>49</b>
12.1	备查文件目录	49
12.2	存放地点	49
12.3	查阅方式	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)
基金简称	鹏华动力增长混合(LOF)
场内简称	鹏华动力
基金主代码	160610
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2007年1月9日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,507,232,228.75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	2007年3月9日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	精选具有高成长性和持续盈利增长潜力的上市公司中价值相对低估的股票,进行积极主动的投资管理,在有效控制投资风险的前提下,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	(1) 股票投资:本基金股票投资采取“自上而下”和“自下而上”相结合的主动投资管理策略,策略分为战略性资产配置、动态资产配置和个股选择等三个层次,重点投资具备高成长性和持续盈利增长潜力的上市公司中价值相对低估的股票。(2) 债券投资:本基金债券投资的主要目的是规避股票投资部分的系统性风险,在投资过程中综合运用久期、收益率曲线、流动性、相对价值挖掘、套利等策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金属于混合型(偏股型)基金,其预期风险和收益高于货币型基金、债券基金、混合型基金中的偏债型基金,低于股票型基金,为证券投资基金中的中等风险品种。

注:无。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鹏华基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
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	95599
传真	0755-82021126	010-68121816
注册地址	深圳市福田区福华三路168号深	北京市东城区建国门内大街69

	圳国际商会中心第 43 楼	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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518048	100031
法定代表人	何如	周慕冰

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

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

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	143,045,176.43
本期利润	157,677,883.85
加权平均基金份额本期利润	0.1026
本期加权平均净值利润率	11.57%
本期基金份额净值增长率	12.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	-99,871,017.26
期末可供分配基金份额利润	-0.0663
期末基金资产净值	1,407,361,211.49
期末基金份额净值	0.934
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	96.41%

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

表中的“期末”均指报告期最后一日，即6月30日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

### 3.2 基金净值表现

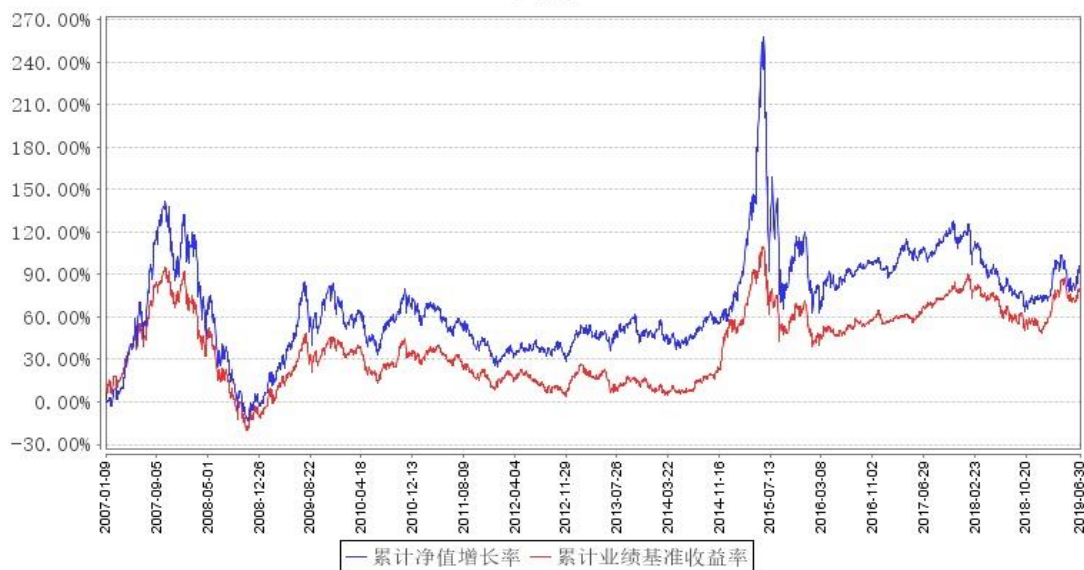
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.11%	1.40%	3.94%	0.81%	3.17%	0.59%
过去三个月	0.11%	1.74%	-0.50%	1.06%	0.61%	0.68%
过去六个月	12.26%	1.51%	19.33%	1.08%	-7.07%	0.43%
过去一年	7.98%	1.23%	8.73%	1.07%	-0.75%	0.16%
过去三年	3.61%	0.99%	19.31%	0.78%	-15.70%	0.21%
自基金成立起至今	96.41%	1.62%	79.01%	1.25%	17.40%	0.37%

注：业绩比较基准=沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鹏华动力增长混合(LOF)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 2007 年 01 月 09 日生效。2、截至建仓期结束,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

### 3.3 其他指标

注:无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日,业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末,公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)、深圳市北融信投资发展有限公司组成,公司性质为中外合资企业。公司原注册资本 8,000 万元人民币,后于 2001 年 9 月完成增资扩股,增至 15,000 万元人民币。截止到 2019 年 6 月,公司管理资产总规模达到 5,644.95 亿元,管理 159 只公募基金、10 只全国社保投资组合、4 只基本养老保险投资组合。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑川江	本基金基金经理	2016-06-24	2019-04-03	10	郑川江先生,国籍中国,经济学硕士,10



					<p>年证券投资基金从业经验。历任鹏华基金管理有限公司研究员，长城证券研究所研究员、所长助理；2015年2月加盟鹏华基金管理有限公司，任职于研究部，从事行业研究工作。2015年06月担任鹏华环保产业股票基金基金经理，2016年01月至2017年03月担任鹏华健康环保混合基金基金经理，2016年06月至2019年04月担任鹏华动力增长混合 (LOF) 基金基金经理，2017年04月至2017年09月担任鹏华新能源产业混合基金基金经理，2017年07月至2019年04月担任鹏华优质治理混合 (LOF) 基金基金经理，2019年04月担任鹏华优选回报混合基金基金经理。郑川江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，增聘张航为本基金基金经理，郑川江不再担任本基金基金经理。</p>
张航	本基金基金经理	2019-04-03	-	4	<p>张航先生，国籍中国，经济学硕士，4年证券投资基金从业经验。2015年7月加盟鹏华基金管理有限公司，现任权益投资二部基金经理。2018年08月担任鹏</p>

					<p>华价值精选股票基金基金经理，2018年11月担任鹏华品牌传承混合基金基金经理，2019年04月担任鹏华动力增长混合 (LOF) 基金基金经理。张航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，增聘张航为本基金基金经理，郑川江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 管理人对报告期内本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 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

低估值的优质金融地产公司依然为压舱石，消费升级包括实物消费和数字消费依然将是我们配置的重点领域，存量经济下更细致的专业化分工领域里的细分龙头将是我们研究的重点。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

鹏华动力增长混合 (LOF) 组合净值增长率 12.26%;鹏华动力增长混合 (LOF) 业绩比较基准增长率 19.33%;

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济在三月份天量信贷和专项债前置下显著回升,但进入二季度以来 PMI 和景气度再次下行,固定资产和工业生产以及房地产投资均明显下行。贸易战一波三折对市场产生了较大的影响,担忧加税和产业转移以致国内失业率上升成为压制市场的主要因素。流动性方面,包商银行事件极大地冲击了同业市场原有的生态,金融供给侧改革进入实质性阶段。全球市场有望开启新一轮宽松周期同时国内经济下滑的担忧逐渐加大,预计国内央行将重新开启宽松间。企业盈利方面,二季度开始减税降费效应预计将在中报中有所显现,同时中报是对贸易冲击下企业真实盈利的检验,有可能成为 7-8 月份影响市场交易的关键变量。

A 股当前估值依然较为便宜,龙头公司的盈利在未来几年确定性相对较高,我们依然认为当前是 A 股市场的战略机遇期。市场演变角度,大消费和金融行业相对市场具有显著的超额收益。资金抱团大白马趋势加强,小部分股票股价和估值均创新高,出现所谓“核心资产牛市”的情形,且仍在惯性加速中,需要紧密关注外在变量对该趋势的影响。

#### 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，本基金可供分配利润为-99,871,017.26元，期末基金份额净值0.934元，不符合利润分配条件。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—鹏华基金管理有限公司2019年1月1日至2019年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，鹏华基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，鹏华基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、

净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：鹏华动力增长混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	77,239,967.08	105,030,219.88
结算备付金		1,588,982.03	30,155,851.34
存出保证金		1,132,560.80	1,137,834.32
交易性金融资产	6.4.7.2	1,333,281,924.18	1,047,025,600.76
其中：股票投资		1,333,281,924.18	1,047,025,600.76
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		-	156,927,010.06
应收利息	6.4.7.5	21,529.18	10,681.91
应收股利		-	-
应收申购款		30,616.22	107,221.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,413,295,579.49	1,340,394,419.29
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	34,601,010.93
应付赎回款		1,158,363.83	328,116.51
应付管理人报酬		1,654,177.76	1,642,186.19
应付托管费		275,696.30	273,697.69
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.7.7	2,490,797.49	1,473,565.80
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	355,332.62	400,170.89
负债合计		5,934,368.00	38,718,748.01
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,507,232,228.75	1,563,671,675.42
未分配利润	6.4.7.10	-99,871,017.26	-261,996,004.14
所有者权益合计		1,407,361,211.49	1,301,675,671.28
负债和所有者权益总计		1,413,295,579.49	1,340,394,419.29

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.934 元，基金份额总额 1,507,232,228.75 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华动力增长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018 年6月30日
一、收入		180,058,731.61	-242,312,884.75
1. 利息收入		897,638.39	1,869,997.47
其中：存款利息收入	6.4.7.11	839,016.04	1,014,918.97
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		58,622.35	855,078.50
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		164,494,298.67	-94,525,547.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	153,174,429.16	-108,089,227.28
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	11,319,869.51	13,563,680.19
3. 公允价值变动收益（损失以	6.4.7.17	14,632,707.42	-149,684,811.24

“-”号填列)			
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	34,087.13	27,476.11
减: 二、费用		22,380,847.76	22,280,172.77
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,116,743.57	11,426,558.04
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,686,123.98	1,904,426.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	10,396,392.05	8,692,375.30
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	181,588.16	256,813.08
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		157,677,883.85	-264,593,057.52
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		157,677,883.85	-264,593,057.52

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)

本报告期: 2019年1月1日至2019年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,563,671,675.42	-261,996,004.14	1,301,675,671.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	157,677,883.85	157,677,883.85
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)	-56,439,446.67	4,447,103.03	-51,992,343.64
其中: 1. 基金申购款	28,431,240.45	-2,835,604.29	25,595,636.16
2. 基金赎回款	-84,870,687.12	7,282,707.32	-77,587,979.80
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)	1,507,232,228.75	-99,871,017.26	1,407,361,211.49
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,574,514,529.08	168,106,006.77	1,742,620,535.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-264,593,057.52	-264,593,057.52
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)	-415,791.30	1,129,187.01	713,395.71
其中：1.基金申购款	104,690,599.98	1,359,922.30	106,050,522.28
2.基金赎回款	-105,106,391.28	-230,735.29	-105,337,126.57
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)	-	-116,680,811.51	-116,680,811.51
五、期末所有者权益(基金净值)	1,574,098,737.78	-212,038,675.25	1,362,060,062.53

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

鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)(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”)证监基金字[2006]第245号《关于同意鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)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《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定。本基金自2006年12月8日至2006年12月28日期间公开发售,首次设立募集不包括认购资金利息共募集11,014,840,003.30元,本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入7,895,780.24元,经德勤华永会计师事务所有限公司德师(上海)报验字(07)第SZ001号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》于2007年1月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为11,022,728,857.13份基金份额,其中认购资金利息折合7,888,853.83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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2007]第26号文审核同意,本基金632,516,873.00份基金份额于2007年3月9日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过本基金代销机构赎回或通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后进行上市交易。

根据《证券投资基金法》及相关法律法规以及《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)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各类股票、债券、央行票据、权证、资产证券化产品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。若有投资需要可参与有价值的新股配售和增发。本基金股票的主要投资方向为具有高成长性和持续盈利增长潜力的上市公司中价值相对低估的增长型股票,本基金对这部分股票的投资比例不低于本基金股票资产的80%。股票资产占基金资产比例为30%-95%;债券资产占基金资产比例为0%-65%;本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;现金或到期日在1年期以内政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准原为:新华富时600成长指数收益率 $\times$ 70%+中证综合债指数收益率 $\times$ 30%。根据本基金的基金管理人2009年5月22日发布的《鹏华基金管理有限公司修改旗下动力增长基金基金合同中“业绩比较基准”定义的公告》,本基金的业绩比较基准修改为:沪深300指数收益率 $\times$ 70%+中证综合债指数收益率 $\times$ 30%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投

资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华动力增长混合型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 2019 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本报告期本基金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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以 2017

年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

#### 6.4.7 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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	77,239,967.08
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 个月以上	-
其他存款	-
合计	77,239,967.08

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,290,565,398.19	1,333,281,924.18	42,716,525.99
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	1,290,565,398.19	1,333,281,924.18	42,716,525.99

#### 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 2019年6月30日
应收活期存款利息	20,426.95
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	643.50
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	458.73
合计	21,529.18

注:其他为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注:无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,490,797.49
银行间市场应付交易费用	-

合计	2,490,797.49
----	--------------

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,746.76
预提费用	353,585.86
合计	355,332.62

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,563,671,675.42	1,563,671,675.42
本期申购	28,431,240.45	28,431,240.45
本期赎回(以“-”号填列)	-84,870,687.12	-84,870,687.12
- 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	1,507,232,228.75	1,507,232,228.75

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。

#### 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	468,110,131.02	-730,106,135.16	-261,996,004.14
本期利润	143,045,176.43	14,632,707.42	157,677,883.85
本期基金份额交易产生的变动数	-21,120,960.09	25,568,063.12	4,447,103.03
其中：基金申购款	10,415,265.74	-13,250,870.03	-2,835,604.29
基金赎回款	-31,536,225.83	38,818,933.15	7,282,707.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	590,034,347.36	-689,905,364.62	-99,871,017.26

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	710,186.93
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	119,786.84

其他	9,042.27
合计	839,016.04

注:其他为申购款利息收入与结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位:人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	3,422,878,486.22
减:卖出股票成本总额	3,269,704,057.06
买卖股票差价收入	153,174,429.16

#### 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
	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	11,319,869.51
基金投资产生的股利收益	-
合计	11,319,869.51

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	14,632,707.42
股票投资	14,632,707.42
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	14,632,707.42

## 6.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	32,946.42
基金转换费收入	1,140.71
合计	34,087.13

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	10,396,392.05
银行间市场交易费用	-
合计	10,396,392.05

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	74,244.51
银行汇划费用	9,402.30
账户维护费	18,000.00
上市年费	29,752.78
其他	600.00
合计	181,588.16

注：其他为上交所账户维护费和查询费。

#### 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、基金销售机构



中国农业银行股份有限公司 (“中国农业银行”)	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司 (“国信证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

注:无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注:无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注:无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

注:无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注:无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,116,743.57	11,426,558.04
其中:支付销售机构的客户维护费	2,433,081.50	2,710,715.65

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
当期发生的基金应支付的托管费	1,686,123.98		1,904,426.35	

注：支付基金托管人中国农业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：本基金本报告期末及上年度末除本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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	77,239,967.08	710,186.93	74,268,308.62	962,575.01

#### 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：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与本管理人、管理人控股股东、托管人、委托人及委托人控股股东承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注:无。

#### 6.4.12 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年07月05日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

##### 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

注: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

本基金为混合型证券投资基金。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,将风险控制在此可承受的范围内。

#### **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农业银行股份有限公司,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2019年6月30日,本基金未持有信用类债券(2018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不得超过该上市公司可流通股票的15%,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%(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 2019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	77,239,967.08	-	-	-	77,239,967.08
结算备付金	1,588,982.03	-	-	-	1,588,982.03
存出保证金	1,132,560.80	-	-	-	1,132,560.80
交易性金融资产	-	-	-	-1,333,281,924.18	1,333,281,924.18
应收利息	-	-	-	21,529.18	21,529.18
应收申购款	-	-	-	30,616.22	30,616.22
资产总计	79,961,509.91	-	-	-1,333,334,069.58	1,413,295,579.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,158,363.83	1,158,363.83
应付管理人报酬	-	-	-	1,654,177.76	1,654,177.76
应付托管费	-	-	-	275,696.30	275,696.30
应付交易费用	-	-	-	2,490,797.49	2,490,797.49
其他负债	-	-	-	355,332.62	355,332.62
负债总计	-	-	-	5,934,368.00	5,934,368.00
利率敏感度缺口	79,961,509.91	-	-	-1,327,399,701.58	1,407,361,211.49
上年度末 2018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	105,030,219.88	-	-	-	105,030,219.88
结算备付金	30,155,851.34	-	-	-	30,155,851.34
存出保证金	1,137,834.32	-	-	-	1,137,834.32
交易性金融资产	-	-	-	-1,047,025,600.76	1,047,025,600.76
应收利息	-	-	-	10,681.91	10,681.91
应收申购款	-	-	-	107,221.02	107,221.02
应收证券清算款	-	-	-	156,927,010.06	156,927,010.06
资产总计	136,323,905.54	-	-	-1,204,070,513.75	1,340,394,419.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	328,116.51	328,116.51
应付管理人报酬	-	-	-	1,642,186.19	1,642,186.19
应付托管费	-	-	-	273,697.69	273,697.69
应付证券清算款	-	-	-	34,601,010.93	34,601,010.93
应付交易费用	-	-	-	1,473,565.80	1,473,565.80
其他负债	-	-	-	400,170.89	400,170.89
负债总计	-	-	-	38,718,748.01	38,718,748.01
利率敏感度缺口	136,323,905.54	-	-	-1,165,351,765.74	1,301,675,671.28

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2019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%。

(2018年12月31日:未持有),因此当利率发生合理、可能的变动时,对于本基金资产净值无

重大影响（2018 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 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。本基金在正常市场状况下，股票资产占基金资产比例为 30%~95%，债券资产占基金资产比例为 0%~65%，权证市值不得超过基金资产净值的 3%。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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	1,333,281,924.18	94.74	1,047,025,600.76	80.44



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	1,333,281,924.18	94.74	1,047,025,600.76	80.44

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

#### 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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	49,206,095.47	40,343,755.96
	业绩比较基准下降5%	-49,206,095.47	-40,343,755.96

#### 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

注：无。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,333,281,924.18	94.34
	其中：股票	1,333,281,924.18	94.34
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	78,828,949.11	5.58
8	其他各项资产	1,184,706.20	0.08
9	合计	1,413,295,579.49	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	12,187,167.00	0.87
B	采矿业	363,431.25	0.03
C	制造业	741,497,122.16	52.69
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	36,608,621.24	2.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,137,212.46	1.00
J	金融业	245,660,829.38	17.46
K	房地产业	282,804,434.09	20.09
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,333,281,924.18	94.74

### 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	601155	新城控股	2,990,089	119,035,443.09	8.46
2	000961	中南建设	13,479,000	116,728,140.00	8.29
3	601318	中国平安	1,290,600	114,360,066.00	8.13
4	002475	立讯精密	4,393,449	108,913,600.71	7.74
5	000333	美的集团	1,993,429	103,379,227.94	7.35
6	600036	招商银行	2,140,031	76,998,315.38	5.47
7	000596	古井贡酒	613,599	72,717,617.49	5.17
8	002142	宁波银行	2,240,200	54,302,448.00	3.86
9	601799	星宇股份	685,911	54,159,532.56	3.85
10	601100	恒立液压	1,717,077	53,881,876.26	3.83
11	000858	五粮液	432,751	51,042,980.45	3.63
12	600519	贵州茅台	49,600	48,806,400.00	3.47
13	600340	华夏幸福	1,444,300	47,040,851.00	3.34
14	000338	潍柴动力	3,494,200	42,943,718.00	3.05
15	603899	晨光文具	955,700	42,022,129.00	2.99
16	002463	沪电股份	2,679,200	36,490,704.00	2.59
17	000568	泸州老窖	429,207	34,692,801.81	2.47
18	000063	中兴通讯	852,200	27,722,066.00	1.97
19	002120	韵达股份	721,643	22,241,037.26	1.58
20	000401	冀东水泥	1,259,300	22,176,273.00	1.58
21	603160	汇顶科技	137,899	19,140,381.20	1.36
22	603338	浙江鼎力	262,381	15,404,388.51	1.09
23	603713	密尔克卫	412,506	14,367,583.98	1.02
24	600845	宝信软件	491,140	13,987,667.20	0.99
25	002714	牧原股份	207,300	12,187,167.00	0.87
26	002798	帝欧家居	427,445	7,826,517.95	0.56
27	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.03
28	300770	新媒股份	1,271	109,941.50	0.01
29	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.01
30	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
31	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
32	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
33	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
34	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000961	中南建设	136,181,249.37	10.46

2	002475	立讯精密	131,228,847.28	10.08
3	601155	新城控股	130,666,109.32	10.04
4	601318	中国平安	122,589,390.63	9.42
5	000333	美的集团	102,406,096.70	7.87
6	601688	华泰证券	84,024,708.83	6.46
7	600030	中信证券	83,395,368.29	6.41
8	000002	万科A	73,288,288.20	5.63
9	600340	华夏幸福	72,950,744.65	5.60
10	000921	海信家电	70,450,836.19	5.41
11	600036	招商银行	70,004,820.86	5.38
12	000596	古井贡酒	66,042,046.90	5.07
13	002142	宁波银行	63,864,928.99	4.91
14	000063	中兴通讯	61,501,462.62	4.72
15	601336	新华保险	57,952,522.11	4.45
16	600837	海通证券	54,439,049.07	4.18
17	300190	维尔利	52,842,088.78	4.06
18	601100	恒立液压	51,069,174.47	3.92
19	601166	兴业银行	49,893,343.74	3.83
20	601799	星宇股份	48,506,229.56	3.73
21	000338	潍柴动力	47,061,365.25	3.62
22	002121	科陆电子	46,385,701.61	3.56
23	600016	民生银行	42,996,857.75	3.30
24	000858	五粮液	42,591,522.70	3.27
25	600519	贵州茅台	42,095,326.17	3.23
26	002027	分众传媒	41,041,194.82	3.15
27	601009	南京银行	37,395,192.52	2.87
28	603713	密尔克卫	36,647,374.34	2.82
29	600845	宝信软件	36,595,594.31	2.81
30	600143	金发科技	35,693,152.35	2.74
31	601186	中国铁建	35,607,904.56	2.74
32	603899	晨光文具	35,555,999.15	2.73
33	002648	卫星石化	35,249,452.03	2.71
34	002926	华西证券	33,929,970.04	2.61
35	002353	杰瑞股份	33,451,985.57	2.57
36	600958	东方证券	33,365,883.20	2.56
37	600583	海油工程	32,840,255.10	2.52
38	002463	沪电股份	32,081,034.54	2.46
39	600068	葛洲坝	31,406,883.51	2.41
40	600600	青岛啤酒	29,541,952.01	2.27
41	000661	长春高新	29,441,577.91	2.26
42	601628	中国人寿	29,189,916.68	2.24
43	603200	上海洗霸	28,963,219.27	2.23

44	601998	中信银行	28,885,315.13	2.22
45	000852	石化机械	28,794,617.72	2.21
46	601225	陕西煤业	28,756,953.90	2.21
47	600585	海螺水泥	28,511,162.00	2.19
48	000568	泸州老窖	28,338,748.80	2.18
49	603496	恒为科技	27,623,360.36	2.12
50	000932	华菱钢铁	27,308,679.54	2.10
51	601377	兴业证券	26,700,093.60	2.05
52	600643	爱建集团	26,687,700.64	2.05
53	600426	华鲁恒升	26,572,919.48	2.04
54	300454	深信服	26,429,685.00	2.03

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 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	96,002,547.46	7.38
2	600027	华电国际	94,528,234.47	7.26
3	600236	桂冠电力	92,502,093.02	7.11
4	600674	川投能源	88,104,534.91	6.77
5	601688	华泰证券	85,071,463.91	6.54
6	600795	国电电力	84,779,534.02	6.51
7	600886	国投电力	80,745,871.21	6.20
8	000063	中兴通讯	73,819,469.18	5.67
9	000543	皖能电力	70,149,001.40	5.39
10	600011	华能国际	66,347,542.08	5.10
11	601991	大唐发电	64,625,926.90	4.96
12	000002	万科A	64,616,847.95	4.96
13	002616	长青集团	64,504,392.12	4.96
14	600900	长江电力	64,340,550.64	4.94
15	002121	科陆电子	61,401,207.00	4.72
16	600837	海通证券	61,136,950.45	4.70
17	601336	新华保险	58,818,287.97	4.52
18	000921	海信家电	56,583,162.95	4.35
19	300190	维尔利	55,414,109.36	4.26
20	000539	粤电力A	53,757,845.89	4.13
21	601166	兴业银行	51,175,388.00	3.93
22	600406	国电南瑞	47,661,066.67	3.66
23	002027	分众传媒	44,711,809.89	3.43
24	300454	深信服	43,728,451.60	3.36
25	002648	卫星石化	43,560,255.28	3.35
26	600016	民生银行	41,766,917.23	3.21

27	002353	杰瑞股份	41,200,601.24	3.17
28	601009	南京银行	39,802,009.20	3.06
29	600143	金发科技	39,043,710.28	3.00
30	600958	东方证券	38,842,478.61	2.98
31	002475	立讯精密	36,620,985.12	2.81
32	601186	中国铁建	35,070,464.36	2.69
33	600583	海油工程	34,115,977.53	2.62
34	000852	石化机械	33,796,611.24	2.60
35	603200	上海洗霸	33,246,494.10	2.55
36	601766	中国中车	32,735,778.92	2.51
37	600068	葛洲坝	31,632,370.21	2.43
38	601377	兴业证券	31,416,396.17	2.41
39	002926	华西证券	30,554,699.17	2.35
40	000661	长春高新	29,637,279.28	2.28
41	601628	中国人寿	29,564,522.13	2.27
42	300124	汇川技术	29,533,390.23	2.27
43	002008	大族激光	29,089,681.80	2.23
44	600323	瀚蓝环境	28,989,731.51	2.23
45	600600	青岛啤酒	28,845,737.00	2.22
46	600585	海螺水泥	28,487,377.99	2.19
47	600643	爱建集团	28,032,115.34	2.15
48	601225	陕西煤业	27,468,082.53	2.11
49	600426	华鲁恒升	27,256,408.71	2.09
50	000932	华菱钢铁	27,126,297.00	2.08
51	600340	华夏幸福	26,859,021.41	2.06
52	600636	三爱富	26,423,196.22	2.03
53	603636	南威软件	26,392,159.34	2.03
54	002350	北京科锐	26,213,010.64	2.01

注:卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	3,541,327,673.06
卖出股票收入(成交)总额	3,422,878,486.22

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:本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

## 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

中南建设 公司涉及信息披露违规问题。2017年11月11日,中南建设与深圳市和润达投资有限公司(以下简称“深圳和润达”)、深圳三瑞房地产开发有限公司(以下简称“深圳三瑞”)签署《深圳市罗湖区草埔城中村城市更新项目合作协议》,中南建设与深圳三瑞分别将持有的中南(深圳)房地产开发有限公司(以下简称“中南房地产”)47%和20%的股权转让与深圳和润达。2017年11月16日,中南建设完成了转让中南房地产47%股权转让的工商变更手续。2017年12月8日,中南建设收到交易方深圳和润达支付的股权转让款。本次交易所产生的投资收益共计金额为50,100万元,此次交易在扣除所得税影响后,股权转让产生的净利润为37,357万元,占中南建

设 2016 年度归母净利润的 92.16%。对于上述重大交易事项，中南建设迟至 2018 年 6 月 7 日才履行信息披露义务，并迟至 2019 年 1 月 17 日才履行股东大会审议程序。中南建设上述行为违反了深圳证券交易所《股票上市规则（2014 年修订）》第 2.1 条、第 7.3 条、第 9.3 条的规定和深圳证券交易所《股票上市规则（2018 年 11 月修订）》第 2.1 条、第 7.3 条、第 9.3 条的规定。中南建设董事长兼总经理陈锦石、时任财务总监钱军未能恪尽职守、履行诚信勤勉义务，违反了深圳交易所《股票上市规则（2014 年修订）》第 1.4 条、第 3.1.5 条的规定和深圳交易所《股票上市规则（2018 年 11 月修订）》第 1.4 条、第 3.1.5 条的规定，对中南建设上述违规行为负有重要责任。鉴于上述违规事实及情节，处分决定如下：一、对江苏中南建设集团股份有限公司给予通报批评的处分。二、对江苏中南建设集团股份有限公司董事长兼总经理陈锦石、时任财务总监钱军、现任董事辛琦、时任董事会秘书张伟给予通报批评的处分。对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司股票的投资价值不产生重大影响，且该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 7.12.2

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,132,560.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,529.18
5	应收申购款	30,616.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,184,706.20

### 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

注：无。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。



## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
78,552	19,187.70	734,670.91	0.05	1,506,497,557.84	99.95

### 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	胡文明	1,287,968.00	2.65
2	李珍林	1,000,440.00	2.06
3	殷丽萍	680,183.00	1.40
4	缪灿衍	570,100.00	1.17
5	楚喜兰	457,735.00	0.94
6	杭州雷峰塔文化旅游 发展有限公司	425,190.00	0.88
7	叶玉芳	406,687.00	0.84
8	冯海燕	348,301.00	0.72
9	修桂珍	324,690.00	0.67
10	周保清	313,002.00	0.64

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、基金投资和研发部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2007年1月9日)基 金份额总额	11,022,728,857.13
本报告期期初基金份额总额	1,563,671,675.42
本报告期基金总申购份额	28,431,240.45
减：本报告期基金总赎回份额	84,870,687.12
本报告期基金拆分变动份额(份额减少 以“-”填列)	-

本报告期末基金份额总额	1,507,232,228.75
-------------	------------------

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动：

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

2019年1月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019年4月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本期基金投资策略相比前期相对更为积极

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

光大证券	1	1,491,688,786.18	21.43%	1,359,372.49	21.39%	-
申万宏源	3	1,150,435,504.55	16.52%	1,048,392.92	16.49%	-
安信证券	1	1,093,440,587.75	15.71%	1,018,314.04	16.02%	-
长江证券	1	1,012,845,026.74	14.55%	923,007.96	14.52%	-
国金证券	1	488,514,369.88	7.02%	445,184.58	7.00%	-
银河证券	1	403,606,156.62	5.80%	367,807.35	5.79%	-
海通证券	1	384,162,865.57	5.52%	350,087.79	5.51%	-
广发证券	1	302,891,897.92	4.35%	276,025.77	4.34%	-
中金公司	1	254,237,085.46	3.65%	231,687.22	3.65%	-
东兴证券	2	219,671,624.56	3.16%	200,183.78	3.15%	-
太平洋证 券	1	107,309,675.95	1.54%	87,060.76	1.37%	-
中信证券	1	53,496,666.07	0.77%	48,751.61	0.77%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注:交易单元选择的标准和程序

1、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构,使用其交易单元作为基金的专用交易单元,选择的标准是:

- (1) 实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币;
- (2) 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;
- (3) 经营行为规范,最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚;
- (4) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

## 2、选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
光大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	153,700,000.00	41.21%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	219,300,000.00	58.79%	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-

华泰证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	2018年第四季度报告	《中国证券报》	2019年01月21日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在浙江金观诚基金销售有限公司暂停办理相关销售业务的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2019年01月22日
3	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	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2019年02月12日
4	鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)更新的招募说明书摘要	《中国证券报》	2019年02月21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	《上海证券报》	2019年02月26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》	2019年02月26日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》	2019年02月26日
8	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》	2019年03月01日
9	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》	2019年03月01日
10	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》	2019年03月01日
11	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》	2019年03月01日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019年03月13日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019年03月13日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《证券日报》	2019年03月13日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019年03月13日
16	2018年年度报告摘要	《中国证券报》	2019年03月28日

17	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国中投证券有限责任公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019年03月29日
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国中投证券有限责任公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019年03月29日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国中投证券有限责任公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019年03月29日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国中投证券有限责任公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《证券日报》	2019年03月29日
21	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资申购费率优惠的公告	《中国证券报》	2019年03月30日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资申购费率优惠的公告	《上海证券报》	2019年03月30日
23	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资申购费率优惠的公告	《证券时报》	2019年03月30日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资申购费率优惠的公告	《证券日报》	2019年03月30日
25	鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)基金经理变更公告	《中国证券报》	2019年04月03日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2019年04月08日
27	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》	2019年04月13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	《上海证券报》	2019年04月13日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金	《证券日报》	2019年04月13日

	持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告		
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	《证券时报》	2019年04月13日
31	2019年第一季度报告	《中国证券报》	2019年04月19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	《证券时报》	2019年05月07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	《上海证券报》	2019年05月07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》	2019年05月07日
35	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	《证券日报》	2019年05月07日
36	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	《上海证券报》	2019年05月13日
37	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	《证券日报》	2019年05月13日
38	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	《证券时报》	2019年05月13日
39	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	《中国证券报》	2019年05月13日
40	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	《证券日报》	2019年05月18日
41	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	《证券时报》	2019年05月18日
42	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	《上海证券报》	2019年05月18日
43	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》	2019年05月18日
44	鹏华基金管理有限公司关于北京恒天明泽基金销售有限公司终止销售本公	《证券日报》	2019年05月22日

	司旗下部分基金的公告		
45	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《上海证券报》	2019年06月20日
46	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《中国证券报》	2019年06月20日
47	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《证券时报》	2019年06月20日
48	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《证券日报》	2019年06月20日
49	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公司认、申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019年06月24日
50	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公司认、申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019年06月24日
51	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公司认、申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019年06月24日
52	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公司认、申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《证券日报》	2019年06月24日
53	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	《证券时报》	2019年06月26日
54	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	《证券日报》	2019年06月26日
55	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》	2019年06月26日
56	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	《上海证券报》	2019年06月26日

注:无。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注:无。



## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》；
- (二)《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)托管协议》；
- (三)《鹏华动力增长混合型证券投资基金(LOF)2019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第43层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9中国农业银行股份有限公司

### 12.3 查阅方式

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

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

鹏华基金管理有限公司

2019年8月23日