

# 鹏华沪深 300 指数证券投资基金(L0F)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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	6
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	9
<b>§4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48

7.8 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 .....	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>63</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 .....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录 .....	63
12.2 存放地点 .....	63
12.3 查阅方式 .....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)	
基金简称	鹏华沪深 300 指数 (LOF)	
场内简称	鹏华 300	
基金主代码	160615	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2009 年 4 月 3 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	254,705,763.48 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	2009 年 5 月 8 日	
下属分级基金的基 金简称	鹏华 300 指数 A 类 (LOF)	鹏华 300 指数 C 类 (LOF)
下属分级基金的交 易代码	160615	006939
报告期末下属分级 基金的份额总额	241,878,692.08 份	12,827,071.40 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资方式,追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化,力争将日平均跟踪误差控制在 0.35%以内,以实现沪深 300 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法,按照成份股在沪深 300 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和成份股发生配股、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,并辅之以金融衍生产品投资

	管理等, 使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金, 其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金, 为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张戈	郭明
	联系电话	0755-82825720	010-66105799
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		何如	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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)	
	鹏华 300 指数 A 类(LOF)	鹏华 300 指数 C 类(LOF)
本期已实现收益	8,996,630.12	176,913.29

本期利润	90,144,455.93	-633,128.21
加权平均基金份额本期利润	0.3570	-0.0868
本期加权平均净值利润率	23.76%	-7.29%
本期基金份额净值增长率	26.61%	22.00%
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	143,728,101.62	507,797.69
期末可供分配基金份额利润	0.5942	0.0396
期末基金资产净值	385,606,793.70	15,654,479.88
期末基金份额净值	1.594	1.220
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	67.06%	22.00%

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

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用 (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。

(4) 自 2019 年 1 月 22 日起鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 增加 C 类基金份额, 故鹏华 300 指数 C 类 (LOF) 的报告期间为 2019 年 1 月 22 日-2019 年 6 月 30 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

鹏华 300 指数 A 类 (LOF)

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①-③	②-④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去一个月	5.77%	1.11%	5.13%	1.10%	0.64%	0.01%
过去三个月	-0.13%	1.46%	-1.11%	1.45%	0.98%	0.01%
过去六个月	26.61%	1.47%	25.66%	1.47%	0.95%	0.00%
过去一年	9.33%	1.44%	8.68%	1.45%	0.65%	-0.01%
过去三年	33.72%	1.05%	20.52%	1.05%	13.20%	0.00%
自基金成立起	67.06%	1.46%	48.15%	1.44%	18.91%	0.02%

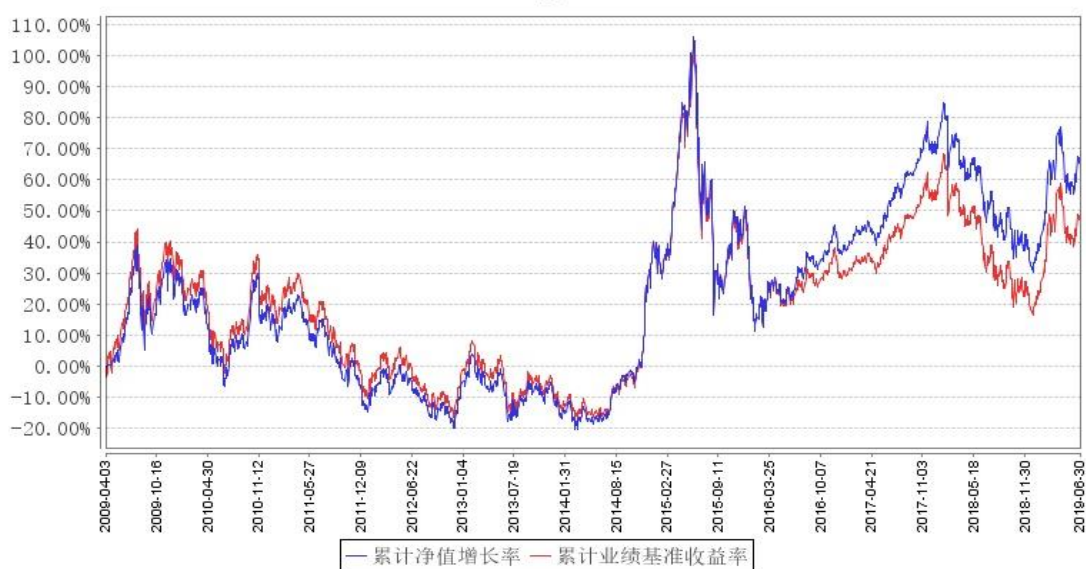
鹏华 300 指数 C 类 (LOF)

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差 ②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.81%	1.12%	5.13%	1.10%	0.68%	0.02%
过去三个月	-0.08%	1.46%	-1.11%	1.45%	1.03%	0.01%
自基金成立起	22.00%	1.52%	19.09%	1.52%	2.91%	0.00%

注:业绩基准=沪深 300 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

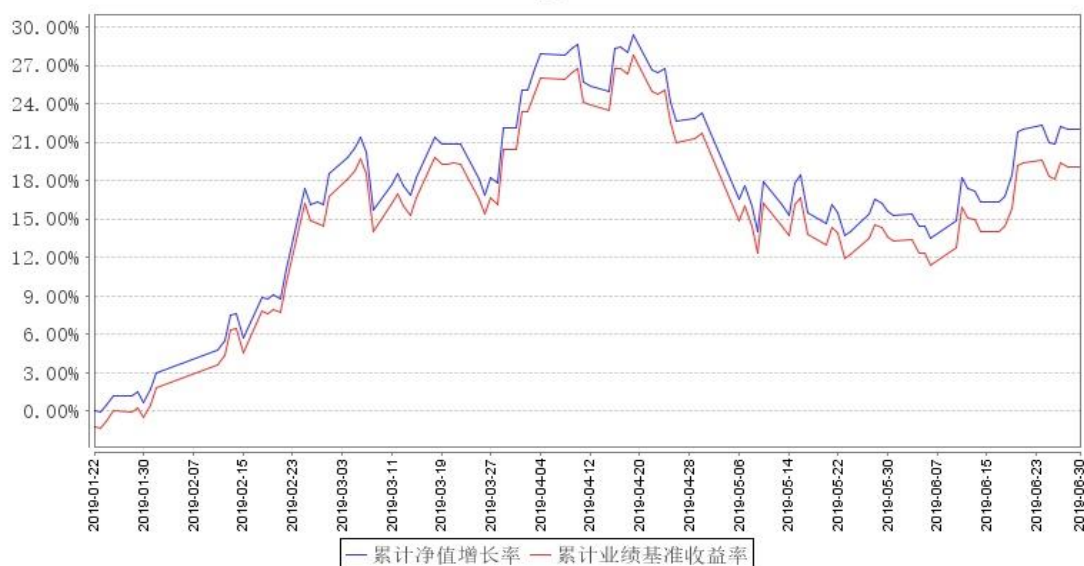
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鹏华300指数A类(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





鹏华300指数C类(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 2009 年 04 月 03 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		
张羽翔	本 基 金 基 金 经 理	2016-09-24	-	12	张羽翔先生,国籍中国,工学硕士,12 年证券基金从业经验。曾任招商银行软

					<p>件中心(原深圳市融博技术公司)数据分析师; 2011 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任监察稽核部资深金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员, 先后从事金融工程、量化研究等工作; 现任量化及衍生品投资部基金经理。2015 年 09 月担任鹏华上证民企 50ETF 联接基金基金经理, 2015 年 09 月担任鹏华上证民企 50ETF 基金基金经理, 2016 年 06 月至 2018 年 05 月担任鹏华新丝路分级基金基金经理, 2016 年 07 月担任鹏华高铁分级基金基金经理, 2016 年 09 月担任鹏华沪深 300 指数 (LOF) 基金基金经理, 2016 年 09 月担任鹏华中证 500 指数 (LOF) 基金基金经理, 2016 年 11 月担任鹏华一带一路分级基金基金经理, 2016 年 11 月担任鹏华新能源分级基金基金经理, 2018 年 04 月担任鹏华互联网分级基金基金经理, 2018 年 04 月担任鹏华创业板分级基金基金经理, 2018 年 05 月至 2018 年 08 月担任鹏华沪深 300 指数增强基金基金经理, 2018 年 05 月担任鹏</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>华香港中小企业指数（LOF）基金基金经理，2018 年 05 月担任鹏华钢铁分级基金基金经理，2019 年 04 月担任酒 ETF 基金基金经理，2019 年 07 月担任国防 ETF 基金基金经理。张羽翔先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。</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

本基金秉承指数基金的投资策略，在应对基金申购赎回的基础上，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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内,鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF) 组合净值增长率 26.61%;业绩比较基准增长率 25.66%;鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF) 组合净值增长率 22.00%;业绩比较基准增长率 19.09%;

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年上半年权益市场受金融去杠杆和贸易战的影响,指数震荡盘整。上半年,积极的财政政策发力,支撑基建投资增速稳定,但财政支出节奏相对较块,下半年的财政支出受空间影响,节奏可能放缓,会对基建资金形成一定影响,地方政府专项债加速发行将在三季度末前发力,预计四季度地方政府又将受到资金方面的压力。地产投资增速可能回落至两位数以下,受销售走低影响,投资保持加速增长的可能性不大。总的来看,固定资产投资增速可能三季度将仍保持稳定。

“国际经济金融形势错综复杂,外部不确定不稳定因素增多”,国际风险因素主要指的是短期内全球经济增长动能偏弱,中美贸易摩擦,各经济体存在脆弱性,地缘政治冲突多点爆发等。国内方面的风险则是出口增速下行,民间投资动能不足,制造业投资上行乏力,综合体现为 2 季度 GDP 增速创 1992 年 1 季度以来新低。“科创板”是定位为支持我国“新经济”公司发展的一个股权市场,是我国产业升级、经济转型之国家战略在资本市场的体现。随着全球技术和产业的变迁,“新经济”公司已经站在了全球企业界的巅峰。“科创板”作为一个变局者,有望成为我国“新经济”公司发展的沃土,在推进我国产业升级的同时,给投资者带来丰厚回报。“科创板”也会改变我国金融格局。

#### 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，鹏华沪深 300 指数 A 类期末可供分配利润为 143,728,101.62 元，期末鹏华沪深 300A 类基金份额净值 1.594 元；鹏华沪深 300 指数 C 类期末可供分配利润为 507,797.69 元，期末鹏华沪深 300C 类基金份额净值 1.220 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

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

本报告期内，本基金托管人在对鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的管理人——鹏华基金管理有限公司在鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 本半年度报告中财务指标、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进行了核查, 以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告 (未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体: 鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (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	22,105,666.97	17,035,708.66
结算备付金		74,432.48	506,502.87
存出保证金		56,574.81	104,934.12
交易性金融资产	6.4.7.2	380,084,415.03	297,947,801.79
其中: 股票投资		380,084,415.03	297,947,801.79
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		-	43,018.21
应收利息	6.4.7.5	3,940.81	4,082.01
应收股利		-	-
应收申购款		1,005,330.48	241,117.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		403,330,360.58	315,883,165.16
<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		1,168.77	-
应付赎回款		1,331,877.11	311,729.78
应付管理人报酬		240,153.82	200,254.19

应付托管费		48,030.78	40,050.83
应付销售服务费		2,786.74	-
应付交易费用	6.4.7.7	113,989.65	315,455.44
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	331,080.13	350,544.90
负债合计		2,069,087.00	1,218,035.14
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	254,705,763.48	249,896,758.18
未分配利润	6.4.7.10	146,555,510.10	64,768,371.84
所有者权益合计		401,261,273.58	314,665,130.02
负债和所有者权益总计		403,330,360.58	315,883,165.16

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 254,705,763.48 份，其中鹏华 300 指数 A 类(LOF)基金份额总额为 241,878,692.08 份，基金份额净值 1.594 元；鹏华 300 指数 C 类(LOF)基金份额总额为 12,827,071.40 份，基金份额净值 1.220 元。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华沪深 300 指数证券投资基金（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		91,725,510.77	-31,664,868.70
1. 利息收入		97,063.07	86,176.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	97,063.07	86,176.66
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）		11,059,050.13	19,554,499.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,029,576.04	16,738,063.07
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	4,029,474.09	2,816,435.93
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.17	80,337,784.31	-51,390,890.59
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	231,613.26	85,346.23
减: 二、费用		2,214,183.05	2,277,166.83
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,434,096.94	1,256,529.13
2. 托管费	6.4.10.2.2	286,819.32	251,305.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	7,573.79	-
4. 交易费用	6.4.7.19	356,566.52	565,624.17
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	129,126.48	203,707.68
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		89,511,327.72	-33,942,035.53
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		89,511,327.72	-33,942,035.53

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (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)	249,896,758.18	64,768,371.84	314,665,130.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	89,511,327.72	89,511,327.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	4,809,005.30	-7,724,189.46	-2,915,184.16
其中: 1. 基金申购款	142,924,612.14	60,256,586.26	203,181,198.40



2. 基金赎回款	-138,115,606.84	-67,980,775.72	-206,096,382.56
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）	254,705,763.48	146,555,510.10	401,261,273.58
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）	220,679,379.85	137,751,189.37	358,430,569.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-33,942,035.53	-33,942,035.53
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-4,005,898.61	-4,592,687.34	-8,598,585.95
其中：1. 基金申购款	51,143,733.07	31,331,200.49	82,474,933.56
2. 基金赎回款	-55,149,631.68	-35,923,887.83	-91,073,519.51
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）	216,673,481.24	99,216,466.50	315,889,947.74

注：报表附注为财务报表的组成部分。

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 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”), 系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[2009]41 号文《关于核准鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 募集的批复》的核准, 由基金管理人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 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的约定募集设立。本基金为上市契约型开放式, 存续期限为不定期, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,994,133,345.09 元, 业经普华永道中天会计师事务所有限公司验证并出具普华永道中天验字(2009)第 051 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2009 年 4 月 3 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 1,994,428,997.48 份基金份额, 其中认购资金利息折合 295,652.39 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, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所 (以下简称“深交所”) 深证上[2009]第 32 号文审核同意, 本基金 394,502,086.00 份基金份额于 2009 年 5 月 8 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跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据鹏华基金管理有限公司《关于鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 和鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 新增 C 类基金份额并修改基金合同的公告》, 本基金根据所收取费用的差异, 将基金份额分为不同的类别, 自 2019 年 1 月 22 日起增设 C 类基金份额, 原有的基金份额转为 A 类基金份额。其中, 在投资人申购基金时收取前端申购费用, 且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额, 称为 A 类基金份额; 从本类别基金资产中计提销售服务费, 且不收取申购费用的基金份额, 称为 C 类基金份额。C 类基金份额通过场外方式申购, 不在交易所上市交易, 亦不开通场内申购赎回方式。除经基金管理人另行公告, C 类基金份额持有人不能进行跨系统转登记。由于基金费用收取方式的不同, A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定, 本基金的标的指数为沪深 300 指数, 投资目标为采用指数化投资方式, 追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化; 本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 主要投资于沪深 300 指数的成份股及其备选成份股 (投资比例不低于基金资产净值的 90%), 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%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外, 为更好的实现投资目标, 本基金将少量投资于非沪深 300 成份股、新股 (首次发行或增发等) 以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基

金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+银行同业存款利率 $\times$ 5%。本基金标的指数使用费由基金管理人鹏华基金管理有限公司承担，不计入本基金费用。

#### 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》、《鹏华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)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	22,105,666.97
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	22,105,666.97

#### 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	347,194,489.45	380,084,415.03	32,889,925.58
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	347,194,489.45	380,084,415.03	32,889,925.58

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

#### 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：截止本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截止本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 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	3,887.80
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	30.15
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	22.86
合计	3,940.81

注：其他为应收结算保证金利息。

## 6.4.7.6 其他资产

注:截至本报告期末,本基金未持有其他资产。

## 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	113,989.65
银行间市场应付交易费用	-
合计	113,989.65

## 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	2,287.65
预提费用	328,792.48
合计	331,080.13

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

鹏华 300 指数 A 类 (LOF)

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	249,896,758.18	249,896,758.18
本期申购	107,397,988.02	107,397,988.02
本期赎回 (以“-”号填列)	-115,416,054.12	-115,416,054.12
-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	241,878,692.08	241,878,692.08

鹏华 300 指数 C 类 (LOF)

项目	本期 2019 年 1 月 22 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
本期申购	35,526,624.12	35,526,624.12
本期赎回 (以“-”号填列)	-22,699,552.72	-22,699,552.72
-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	12,827,071.40	12,827,071.40

注：1、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。

2、自 2019 年 1 月 22 日起鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）增加 C 类基金份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

鹏华 300 指数 A 类 (LOF)			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	216,540,717.98	-151,772,346.14	64,768,371.84
本期利润	8,996,630.12	81,147,825.81	90,144,455.93
本期基金份额 交易产生的变 动数	-7,362,340.96	-3,822,385.19	-11,184,726.15
其中：基金申 购款	93,060,416.51	-40,547,360.82	52,513,055.69
基金赎 回款	-100,422,757.47	36,724,975.63	-63,697,781.84
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	218,175,007.14	-74,446,905.52	143,728,101.62
鹏华 300 指数 C 类 (LOF)			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	176,913.29	-810,041.50	-633,128.21
本期基金份额 交易产生的变 动数	330,884.40	3,129,652.29	3,460,536.69
其中：基金申 购款	1,060,062.26	6,683,468.31	7,743,530.57
基金赎 回款	-729,177.86	-3,553,816.02	-4,282,993.88
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	507,797.69	2,319,610.79	2,827,408.48

#### 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	82,149.88
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	2,490.13
其他	12,423.06
合计	97,063.07

注:其他为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

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	125,036,836.43
减:卖出股票成本总额	118,007,260.39
买卖股票差价收入	7,029,576.04

#### 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:本基金本报告期没有发生衍生工具收益。

**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	4,029,474.09
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,029,474.09

**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	80,337,784.31
股票投资	80,337,784.31
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	80,337,784.31

**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	208,937.54
基金转换费收入	22,675.72
合计	231,613.26

#### 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	356,566.52
银行间市场交易费用	—
合计	356,566.52

#### 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	24,795.19
信息披露费	74,244.51
银行汇划费用	334.00
上市年费	29,752.78
合计	129,126.48

#### 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
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
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、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

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
国信证券	108,704,379.40	44.77	193,333,242.55	52.15

## 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方发生债券回购交易。

## 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行权证交易。

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	99,927.24	47.59	70,290.21	61.66
关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	179,735.58	53.14	64,990.32	51.89

注：1、佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=买（卖）成交金额×1‰-买（卖）经手费-买（卖）证管费等由券商承担的费用

深圳证券交易所的交易佣金=买（卖）成交金额×1‰-买（卖）经手费-买（卖）证管费等由

## 券商承担的费用

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

2、本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易单元租用协议》。根据协议规定,上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

## 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	1,434,096.94	1,256,529.13
其中:支付销售机构的客户维护费	267,738.51	240,466.28

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 0.75%,逐日计提,按月支付。日管理费=前一日基金资产净值 $\times$ 0.75% $\div$ 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
当期发生的基金应支付的托管费	286,819.32	251,305.85

注:支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费年费率为 0.15%,逐日计提,按月支付。

日托管费=前一日基金资产净值 $\times$ 0.15% $\div$ 当年天数。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019 年 1 月 22 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华 300 指数 A 类 (LOF)	鹏华 300 指数 C 类 (LOF)	合计
鹏华基金公司	-	1,343.22	1,343.22

合计	-	1,343.22	1,343.22
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	鹏华 300 指数 A 类 (LOF)	鹏华 300 指数 C 类 (LOF)	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-

注:1、支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%，逐日计提，按月支付，A 类基金份额不支付销售服务费。日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.20%÷当年天数。

2、自 2019 年 1 月 22 日起鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 增加 C 类基金份额，故鹏华 300 指数 C 类 (LOF) 的销售服务费无上年度可比期间数据。

#### 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:本基金本报告期及上年度可比期间没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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
工商银行	22,105,666.97	82,149.88	28,146,435.10	81,753.01

#### 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

于 2019 年 06 月 30 日, 本基金持有 661,900.00 股基金托管人中国工商银行发行的 A 股普通股, 成本总额为人民币 3,671,327.58 元, 估值总额为人民币 3,898,591.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.97%; 本基金持有 75,500.00 股基金管理人的股东国信证券股份有限公司发行的 A 股普通股, 成本总额为人民币 774,573.60 元, 估值总额为人民币 993,580.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.25%。(于 2018 年 12 月 31 日, 本基金持有 684,400.00 股基金托管人中国工商银行发行的 A 股普通股, 成本总额为人民币 3,773,637.08 元, 估值总额为人民币 3,620,476.00 元, 占基金资产净值的比例为 1.15%; 本基金持有 78,300.00 股基金管理人的股东国信证券股份有限公司发行的 A 股普通股, 成本总额为人民币 759,336.72 元, 估值总额为人民币 655,371.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.20%)。

#### 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	新股未上市	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

注:截至本报告期末, 本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限的债券及权证等其他证券。

##### 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
600485	*ST 信威	2016 年 12 月 26 日	重大事项	7.49	2019 年 07 月 12 日	13.86	43,902	808,352.71	328,825.98	-

##### 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

截至本报告期末, 本基金没有从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 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工商银行股份有限公司, 与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算, 违约风险可能性很小; 在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程, 通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险, 且通过分散化投资以分散信用风险。于 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、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的全



部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 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时间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为银行存款、结算备付金，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 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	22,105,666.97	-	-	-	22,105,666.97
结算备付金	74,432.48	-	-	-	74,432.48
存出保证金	56,574.81	-	-	-	56,574.81
交易性金融资产	-	-	-	380,084,415.03	380,084,415.03
应收利息	-	-	-	3,940.81	3,940.81
应收申购款	-	-	-	1,005,330.48	1,005,330.48
资产总计	22,236,674.26	-	-	381,093,686.32	403,330,360.58
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,331,877.11	1,331,877.11
应付管理人报酬	-	-	-	240,153.82	240,153.82
应付托管费	-	-	-	48,030.78	48,030.78
应付证券清算款	-	-	-	1,168.77	1,168.77
应付销售服务费	-	-	-	2,786.74	2,786.74
应付交易费用	-	-	-	113,989.65	113,989.65
其他负债	-	-	-	331,080.13	331,080.13
负债总计	-	-	-	2,069,087.00	2,069,087.00
利率敏感度缺口	22,236,674.26	-	-	379,024,599.32	401,261,273.58
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	17,035,708.66	-	-	-	17,035,708.66
结算备付金	506,502.87	-	-	-	506,502.87
存出保证金	104,934.12	-	-	-	104,934.12
交易性金融资产	-	-	-	297,947,801.79	297,947,801.79
应收利息	-	-	-	4,082.01	4,082.01
应收申购款	-	-	-	241,117.50	241,117.50
应收证券清算款	-	-	-	43,018.21	43,018.21
资产总计	17,647,145.65	-	-	298,236,019.51	315,883,165.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	311,729.78	311,729.78
应付管理人报酬	-	-	-	200,254.19	200,254.19

应付托管费	-	-	-	40,050.83	40,050.83
应付交易费用	-	-	-	315,455.44	315,455.44
其他负债	-	-	-	350,544.90	350,544.90
负债总计	-	-	-	1,218,035.14	1,218,035.14
利率敏感度缺口	17,647,145.65	-	-	-297,017,984.37	314,665,130.02

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 外汇风险的敏感性分析

假设	-	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
	相关风险变量的变 动	本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
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。本基金主要投资于标的指数成分券和备选成分券，所面临的其他价格风险来源于标的指数成分券和备选成分券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分券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 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	380,084,415.03	94.72	297,947,801.79	94.69
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	380,084,415.03	94.72	297,947,801.79	94.69

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%	18,860,735.98	14,757,998.38
	业绩比较基准下降 5%	-18,860,735.98	-14,757,998.38

注:无。

## 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

## 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	380,084,415.03	94.24
	其中:股票	380,084,415.03	94.24
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	22,180,099.45	5.50
8	其他各项资产	1,065,846.10	0.26
9	合计	403,330,360.58	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	4,542,366.00	1.13
B	采矿业	12,234,959.98	3.05
C	制造业	151,677,894.54	37.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,628,423.92	2.15
E	建筑业	11,537,692.97	2.88
F	批发和零售业	5,190,045.15	1.29
G	交通运输、仓储和邮政业	11,677,675.96	2.91
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,790,309.66	3.44
J	金融业	133,165,790.73	33.19

K	房地产业	17,361,159.14	4.33
L	租赁和商务服务业	5,350,106.30	1.33
M	科学研究和技术服务业	286,044.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	452,123.81	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,896,343.03	0.47
R	文化、体育和娱乐业	1,795,266.00	0.45
S	综合	-	-
	合计	379,586,201.19	94.60

### 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

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	258,596.20	0.06
C	制造业	176,907.28	0.04
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	39,603.76	0.01
J	金融业	-	-
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	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	498,213.84	0.12

## 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	332,385	29,452,634.85	7.34
2	600519	贵州茅台	15,447	15,199,848.00	3.79
3	600036	招商银行	316,555	11,389,648.90	2.84
4	601166	兴业银行	446,252	8,161,949.08	2.03
5	000651	格力电器	147,706	8,123,830.00	2.02
6	000333	美的集团	141,936	7,360,800.96	1.83
7	000858	五 粮 液	59,580	7,027,461.00	1.75
8	600276	恒瑞医药	95,052	6,273,432.00	1.56
9	600887	伊利股份	187,087	6,250,576.67	1.56
10	600030	中信证券	241,601	5,752,519.81	1.43
11	601328	交通银行	843,100	5,159,772.00	1.29
12	600016	民生银行	761,734	4,837,010.90	1.21
13	601288	农业银行	1,175,543	4,231,954.80	1.05
14	600000	浦发银行	360,300	4,208,304.00	1.05
15	000002	万 科 A	149,232	4,150,141.92	1.03
16	601398	工商银行	661,900	3,898,591.00	0.97
17	601668	中国建筑	644,147	3,703,845.25	0.92
18	000001	平安银行	263,510	3,631,167.80	0.90
19	600900	长江电力	202,530	3,625,287.00	0.90
20	600837	海通证券	248,313	3,523,561.47	0.88
21	601601	中国太保	96,479	3,522,448.29	0.88
22	002415	海康威视	114,786	3,165,797.88	0.79
23	300498	温氏股份	84,700	3,037,342.00	0.76
24	600048	保利地产	219,081	2,795,473.56	0.70
25	600104	上汽集团	107,607	2,743,978.50	0.68
26	601169	北京银行	454,117	2,683,831.47	0.67
27	601888	中国国旅	30,034	2,662,514.10	0.66
28	603288	海天味业	24,900	2,614,500.00	0.65
29	600585	海螺水泥	61,431	2,549,386.50	0.64
30	601211	国泰君安	138,400	2,539,640.00	0.63
31	000725	京东方 A	727,305	2,501,929.20	0.62
32	600009	上海机场	29,647	2,483,825.66	0.62
33	601988	中国银行	646,708	2,418,687.92	0.60
34	601766	中国中车	298,676	2,416,288.84	0.60

35	000063	中兴通讯	73,000	2,374,690.00	0.59
36	600031	三一重工	179,907	2,353,183.56	0.59
37	002304	洋河股份	18,550	2,254,938.00	0.56
38	601688	华泰证券	100,615	2,245,726.80	0.56
39	600028	中国石化	410,495	2,245,407.65	0.56
40	300059	东方财富	164,845	2,233,649.75	0.56
41	601088	中国神华	101,292	2,064,330.96	0.51
42	600309	万华化学	48,197	2,062,349.63	0.51
43	601229	上海银行	167,660	1,986,771.00	0.50
44	600690	海尔智家	112,346	1,942,462.34	0.48
45	002142	宁波银行	79,931	1,937,527.44	0.48
46	002475	立讯精密	75,776	1,878,487.04	0.47
47	601818	光大银行	488,624	1,861,657.44	0.46
48	000568	泸州老窖	22,540	1,821,908.20	0.45
49	000338	潍柴动力	147,092	1,807,760.68	0.45
50	600340	华夏幸福	55,338	1,802,358.66	0.45
51	601012	隆基股份	77,920	1,800,731.20	0.45
52	600019	宝钢股份	273,455	1,777,457.50	0.44
53	600050	中国联通	285,802	1,760,540.32	0.44
54	601857	中国石油	248,473	1,709,494.24	0.43
55	002027	分众传媒	315,340	1,668,148.60	0.42
56	601989	中国重工	280,900	1,561,804.00	0.39
57	600919	江苏银行	212,600	1,543,476.00	0.38
58	601939	建设银行	206,153	1,533,778.32	0.38
59	001979	招商蛇口	72,845	1,522,460.50	0.38
60	601009	南京银行	182,211	1,505,062.86	0.38
61	002714	牧原股份	25,600	1,505,024.00	0.38
62	600999	招商证券	87,818	1,500,809.62	0.37
63	002230	科大讯飞	44,978	1,495,068.72	0.37
64	601390	中国中铁	228,747	1,491,430.44	0.37
65	601006	大秦铁路	182,531	1,476,675.79	0.37
66	600015	华夏银行	188,897	1,454,506.90	0.36
67	601628	中国人寿	51,149	1,448,539.68	0.36
68	000661	长春高新	4,200	1,419,600.00	0.35
69	002594	比亚迪	27,873	1,413,718.56	0.35
70	601336	新华保险	25,600	1,408,768.00	0.35
71	601186	中国铁建	141,193	1,404,870.35	0.35
72	601899	紫金矿业	371,527	1,400,656.79	0.35
73	000166	申万宏源	276,600	1,385,766.00	0.35
74	600570	恒生电子	19,780	1,348,007.00	0.34
75	000538	云南白药	16,051	1,338,974.42	0.33
76	002024	苏宁易购	114,277	1,311,899.96	0.33



77	600352	浙江龙盛	79,934	1,260,559.18	0.31
78	000776	广发证券	90,840	1,248,141.60	0.31
79	601669	中国电建	234,753	1,241,843.37	0.31
80	601933	永辉超市	117,516	1,199,838.36	0.30
81	300015	爱尔眼科	38,119	1,180,545.43	0.29
82	600958	东方证券	109,900	1,173,732.00	0.29
83	601225	陕西煤业	122,749	1,134,200.76	0.28
84	000876	新 希 望	64,700	1,123,839.00	0.28
85	000100	TCL 集团	332,633	1,107,667.89	0.28
86	601155	新城控股	27,700	1,102,737.00	0.27
87	300142	沃森生物	37,800	1,072,008.00	0.27
88	600436	片仔癀	9,300	1,071,360.00	0.27
89	600406	国电南瑞	56,737	1,057,577.68	0.26
90	002202	金风科技	84,756	1,053,517.08	0.26
91	600741	华域汽车	48,412	1,045,699.20	0.26
92	600588	用友网络	38,150	1,025,472.00	0.26
93	002736	国信证券	75,500	993,580.00	0.25
94	600660	福耀玻璃	43,025	977,958.25	0.24
95	601377	兴业证券	143,910	969,953.40	0.24
96	000157	中联重科	157,638	947,404.38	0.24
97	600010	包钢股份	559,514	945,578.66	0.24
98	600547	山东黄金	22,800	938,676.00	0.23
99	000783	长江证券	118,765	927,554.65	0.23
100	600795	国电电力	361,843	919,081.22	0.23
101	002008	大族激光	26,286	903,712.68	0.23
102	601901	方正证券	126,338	898,263.18	0.22
103	600705	中航资本	165,304	895,947.68	0.22
104	601111	中国国航	91,751	878,057.07	0.22
105	000069	华侨城 A	125,899	874,998.05	0.22
106	600111	北方稀土	66,903	859,034.52	0.21
107	603993	洛阳钼业	216,900	858,924.00	0.21
108	600703	三安光电	75,107	847,206.96	0.21
109	601108	财通证券	77,100	846,558.00	0.21
110	600011	华能国际	135,000	841,050.00	0.21
111	600438	通威股份	59,600	837,976.00	0.21
112	600383	金地集团	69,359	827,452.87	0.21
113	600089	特变电工	114,030	826,717.50	0.21
114	601800	中国交建	72,130	816,511.60	0.20
115	600029	南方航空	105,654	815,648.88	0.20
116	600886	国投电力	104,140	809,167.80	0.20
117	002236	大华股份	55,225	801,867.00	0.20
118	601985	中国核电	143,300	796,748.00	0.20

119	600271	航天信息	34,318	791,029.90	0.20
120	002422	科伦药业	26,600	790,818.00	0.20
121	002007	华兰生物	25,833	787,648.17	0.20
122	601600	中国铝业	200,717	786,810.64	0.20
123	600196	复星医药	30,891	781,542.30	0.19
124	600606	绿地控股	112,100	765,643.00	0.19
125	002001	新 和 成	39,600	763,884.00	0.19
126	000895	双汇发展	30,468	758,348.52	0.19
127	601555	东吴证券	73,700	755,425.00	0.19
128	300003	乐普医疗	32,800	755,056.00	0.19
129	600115	东方航空	120,383	754,801.41	0.19
130	002311	海大集团	24,300	750,870.00	0.19
131	600061	国投资本	51,900	727,119.00	0.18
132	600109	国金证券	74,300	722,196.00	0.18
133	600221	海航控股	353,107	716,807.21	0.18
134	002044	美年健康	57,540	715,797.60	0.18
135	600332	白云山	17,335	710,214.95	0.18
136	300124	汇川技术	30,599	701,023.09	0.17
137	000963	华东医药	26,893	698,142.28	0.17
138	000413	东旭光电	134,520	691,432.80	0.17
139	600522	中天科技	75,300	690,501.00	0.17
140	600487	亨通光电	40,980	686,824.80	0.17
141	601788	光大证券	60,000	685,200.00	0.17
142	603019	中科曙光	19,500	684,450.00	0.17
143	600177	雅戈尔	107,750	684,212.50	0.17
144	002410	广联达	20,800	684,112.00	0.17
145	600018	上港集团	99,583	679,156.06	0.17
146	000768	中航飞机	42,559	670,304.25	0.17
147	601618	中国中冶	219,200	666,368.00	0.17
148	600637	东方明珠	63,212	666,254.48	0.17
149	600100	同方股份	72,800	658,840.00	0.16
150	300033	同花顺	6,600	649,176.00	0.16
151	002352	顺丰控股	19,000	645,240.00	0.16
152	300017	网宿科技	59,775	644,374.50	0.16
153	601607	上海医药	35,495	644,234.25	0.16
154	000425	徐工机械	144,240	643,310.40	0.16
155	300122	智飞生物	14,800	637,880.00	0.16
156	600893	航发动力	27,700	629,067.00	0.16
157	300408	三环集团	32,100	624,345.00	0.16
158	002271	东方雨虹	27,500	623,150.00	0.16
159	600176	中国巨石	64,500	614,685.00	0.15
160	601877	正泰电器	26,500	611,885.00	0.15

161	600516	方大炭素	49,617	609,792.93	0.15
162	600498	烽火通信	21,600	601,776.00	0.15
163	601919	中远海控	118,800	596,376.00	0.15
164	300136	信维通信	24,000	586,800.00	0.15
165	601727	上海电气	108,258	582,428.04	0.15
166	600004	白云机场	31,800	578,760.00	0.14
167	600867	通化东宝	37,500	577,500.00	0.14
168	000728	国元证券	62,000	568,540.00	0.14
169	002460	赣锋锂业	24,000	562,320.00	0.14
170	601998	中信银行	94,051	561,484.47	0.14
171	000423	东阿阿胶	14,057	559,749.74	0.14
172	600809	山西汾酒	8,100	559,305.00	0.14
173	600023	浙能电力	125,265	553,671.30	0.14
174	600489	中金黄金	53,000	544,310.00	0.14
175	002673	西部证券	53,800	542,304.00	0.14
176	002466	天齐锂业	21,095	533,281.60	0.13
177	601018	宁波港	121,272	532,384.08	0.13
178	002241	歌尔股份	59,836	531,942.04	0.13
179	600066	宇通客车	40,800	531,216.00	0.13
180	600068	葛洲坝	84,782	528,191.86	0.13
181	002179	中航光电	15,780	527,998.80	0.13
182	600926	杭州银行	63,060	525,289.80	0.13
183	300144	宋城演艺	22,300	516,022.00	0.13
184	600170	上海建工	136,664	513,856.64	0.13
185	601997	贵阳银行	59,300	512,945.00	0.13
186	300024	机器人	33,580	511,423.40	0.13
187	002081	金螳螂	49,366	508,963.46	0.13
188	601021	春秋航空	11,300	508,500.00	0.13
189	601198	东兴证券	42,400	503,712.00	0.13
190	600362	江西铜业	31,877	501,743.98	0.13
191	002146	荣盛发展	53,398	501,407.22	0.12
192	600398	海澜之家	55,200	500,664.00	0.12
193	600482	中国动力	21,100	498,382.00	0.12
194	600219	南山铝业	220,100	497,426.00	0.12
195	002602	世纪华通	45,472	496,554.24	0.12
196	000961	中南建设	57,000	493,620.00	0.12
197	600085	同仁堂	16,919	490,651.00	0.12
198	601838	成都银行	55,500	490,065.00	0.12
199	601881	中国银河	39,600	485,100.00	0.12
200	600674	川投能源	54,084	481,347.60	0.12
201	603156	养元饮品	12,960	480,556.80	0.12
202	000630	铜陵有色	193,890	476,969.40	0.12

203	000703	恒逸石化	34,900	476,734.00	0.12
204	002739	万达电影	25,600	472,064.00	0.12
205	000786	北新建材	26,000	471,380.00	0.12
206	002493	荣盛石化	38,700	466,722.00	0.12
207	600535	天士力	27,929	462,224.95	0.12
208	603986	兆易创新	5,300	459,510.00	0.11
209	002456	欧菲光	58,270	456,836.80	0.11
210	300070	碧水源	58,039	452,123.81	0.11
211	002050	三花智控	42,490	448,269.50	0.11
212	600297	广汇汽车	100,450	448,007.00	0.11
213	000629	攀钢钒钛	131,800	446,802.00	0.11
214	002555	三七互娱	32,600	441,730.00	0.11
215	601138	工业富联	36,600	441,030.00	0.11
216	300296	利亚德	54,700	428,301.00	0.11
217	600369	西南证券	86,700	428,298.00	0.11
218	603799	华友钴业	19,870	423,429.70	0.11
219	600663	陆家嘴	27,100	420,050.00	0.10
220	603833	欧派家居	3,900	419,718.00	0.10
221	002624	完美世界	16,200	418,122.00	0.10
222	000596	古井贡酒	3,500	414,785.00	0.10
223	600208	新湖中宝	131,997	414,470.58	0.10
224	600118	中国卫星	18,184	410,049.20	0.10
225	002065	东华软件	57,400	401,226.00	0.10
226	000625	长安汽车	59,865	396,904.95	0.10
227	002508	老板电器	14,600	396,244.00	0.10
228	000656	金科股份	65,600	395,568.00	0.10
229	600346	恒力石化	32,460	394,713.60	0.10
230	000627	天茂集团	60,700	393,943.00	0.10
231	000709	河钢股份	130,367	389,797.33	0.10
232	603160	汇顶科技	2,800	388,640.00	0.10
233	600153	建发股份	43,590	387,079.20	0.10
234	002032	苏泊尔	5,100	386,733.00	0.10
235	601992	金隅集团	102,400	385,024.00	0.10
236	601878	浙商证券	41,000	381,300.00	0.10
237	600583	海油工程	67,879	380,122.40	0.09
238	600027	华电国际	100,000	377,000.00	0.09
239	600760	中航沈飞	12,900	374,487.00	0.09
240	600038	中直股份	9,100	373,282.00	0.09
241	601117	中国化学	60,600	364,812.00	0.09
242	600977	中国电影	23,000	360,180.00	0.09
243	002153	石基信息	9,905	358,461.95	0.09
244	603858	步长制药	13,620	350,987.40	0.09

245	600688	上海石化	67,512	348,361.92	0.09
246	600415	小商品城	83,530	344,143.60	0.09
247	601216	君正集团	103,626	340,929.54	0.08
248	002558	巨人网络	18,700	339,779.00	0.08
249	600816	安信信托	67,172	339,218.60	0.08
250	600485	*ST 信威	43,902	328,825.98	0.08
251	000671	阳光城	49,800	322,704.00	0.08
252	002252	上海莱士	45,800	318,310.00	0.08
253	601238	广汽集团	28,500	311,505.00	0.08
254	601319	中国人保	32,700	310,323.00	0.08
255	601633	长城汽车	37,027	306,213.29	0.08
256	600566	济川药业	10,100	304,111.00	0.08
257	002010	传化智联	40,000	301,200.00	0.08
258	002310	东方园林	49,500	297,000.00	0.07
259	600188	兖州煤业	27,314	296,903.18	0.07
260	601066	中信建投	13,800	290,904.00	0.07
261	002294	信立泰	12,900	288,702.00	0.07
262	000402	金融街	36,717	287,861.28	0.07
263	600704	物产中大	52,955	287,016.10	0.07
264	300072	三聚环保	36,080	286,114.40	0.07
265	603259	药明康德	3,300	286,044.00	0.07
266	000898	鞍钢股份	73,710	279,360.90	0.07
267	002601	龙蟠佰利	18,800	278,804.00	0.07
268	002120	韵达股份	8,890	273,989.80	0.07
269	601898	中煤能源	56,200	269,760.00	0.07
270	601360	三六零	12,477	266,758.26	0.07
271	002773	康弘药业	8,090	266,322.80	0.07
272	300413	芒果超媒	6,400	262,720.00	0.07
273	002411	延安必康	14,100	245,340.00	0.06
274	600372	中航电子	16,267	241,402.28	0.06
275	000938	紫光股份	8,828	240,563.00	0.06
276	601228	广州港	57,100	238,678.00	0.06
277	002468	申通快递	9,400	234,436.00	0.06
278	002938	鹏鼎控股	7,800	229,008.00	0.06
279	600025	华能水电	55,300	225,071.00	0.06
280	000415	渤海租赁	57,000	223,440.00	0.06
281	600339	中油工程	51,400	216,908.00	0.05
282	600998	九州通	17,300	213,828.00	0.05
283	300251	光线传媒	27,100	184,280.00	0.05
284	601808	中海油服	18,200	175,266.00	0.04
285	002939	长城证券	10,500	175,245.00	0.04
286	601162	天风证券	15,900	172,356.00	0.04

287	300433	蓝思科技	24,099	167,970.03	0.04
288	002925	盈趣科技	4,200	163,842.00	0.04
289	002945	华林证券	8,300	153,550.00	0.04
290	600390	五矿资本	16,200	152,766.00	0.04
291	000408	藏格控股	18,400	152,168.00	0.04
292	601828	美凯龙	12,400	150,660.00	0.04
293	000553	安道麦 A	14,000	150,080.00	0.04
294	603260	合盛硅业	3,100	145,886.00	0.04
295	600233	圆通速递	11,300	139,329.00	0.03
296	601298	青岛港	14,900	125,011.00	0.03
297	002625	光启技术	13,280	123,371.20	0.03
298	601212	白银有色	26,600	116,774.00	0.03
299	601577	长沙银行	11,600	110,664.00	0.03
300	600733	北汽蓝谷	12,900	106,554.00	0.03
301	600299	安迪苏	9,100	94,367.00	0.02

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600968	海油发展	72,844	258,596.20	0.06
2	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.02
3	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
4	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.01
5	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
6	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
7	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01

### 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	601318	中国平安	6,389,568.00	2.03
2	300498	温氏股份	3,247,234.64	1.03
3	601166	兴业银行	2,811,110.00	0.89
4	600036	招商银行	2,688,320.00	0.85
5	600519	贵州茅台	2,635,717.09	0.84
6	600030	中信证券	2,234,054.08	0.71
7	603993	洛阳钼业	2,087,150.00	0.66
8	000651	格力电器	1,928,558.00	0.61
9	600276	恒瑞医药	1,928,356.19	0.61
10	000333	美的集团	1,807,141.00	0.57
11	601328	交通银行	1,465,053.00	0.47

12	600016	民生银行	1,342,816.00	0.43
13	600887	伊利股份	1,308,829.00	0.42
14	601012	隆基股份	1,287,585.80	0.41
15	000858	五 粮 液	1,234,434.33	0.39
16	601288	农业银行	1,223,964.00	0.39
17	601088	中国神华	1,123,016.00	0.36
18	600000	浦发银行	1,121,126.55	0.36
19	000002	万 科 A	1,101,030.00	0.35
20	002415	海康威视	1,077,072.77	0.34

注:买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	7,864,433.65	2.50
2	600519	贵州茅台	3,328,797.86	1.06
3	600036	招商银行	3,219,236.00	1.02
4	000651	格力电器	2,365,681.61	0.75
5	000333	美的集团	2,163,971.70	0.69
6	600030	中信证券	2,011,058.00	0.64
7	601166	兴业银行	1,897,163.00	0.60
8	000858	五 粮 液	1,666,806.00	0.53
9	601328	交通银行	1,617,220.00	0.51
10	600887	伊利股份	1,582,051.62	0.50
11	600016	民生银行	1,508,605.00	0.48
12	603993	洛阳钼业	1,382,046.00	0.44
13	601288	农业银行	1,365,552.00	0.43
14	000002	万 科 A	1,327,248.00	0.42
15	600276	恒瑞医药	1,321,589.42	0.42
16	600000	浦发银行	1,250,972.30	0.40
17	601012	隆基股份	1,237,474.50	0.39
18	600482	中国动力	1,222,218.00	0.39
19	601668	中国建筑	1,172,633.60	0.37
20	002415	海康威视	1,142,780.20	0.36

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	119,806,089.32
卖出股票收入(成交)总额	125,036,836.43

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:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:无。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:无。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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

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

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	56,574.81
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	3,940.81
5	应收申购款	1,005,330.48
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,065,846.10

## 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 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

## 7.12.6 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。

## 7.12.7 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。

# § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
鹏 华 300 指 数 A 类 (LOF)	32,557	7,429.39	54,844,265.88	22.67%	187,034,426.20	77.33%
鹏 华 300	398	32,228.82	0.00	0.00%	12,827,071.40	100.00%

指 数 C 类 (LOF)						
合计	32,955	7,728.90	54,844,265.88	21.53	199,861,497.60	78.47

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

鹏华 300 指数 A 类 (LOF)

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	宁波航发贸易有限公司	869,380.00	13.07
2	高德荣	266,487.00	4.01
3	陈 (金监) 铭	248,900.00	3.74
4	欧静虹	208,300.00	3.13
5	李宏英	198,013.00	2.98
6	袁忠东	193,590.00	2.91
7	李超	159,281.00	2.40
8	尹石荪	144,915.00	2.18
9	周建康	137,625.00	2.07
10	朱洪宏	137,200.00	2.06

注:持有人为场内持有人。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏华 300 指数 A 类 (LOF)	481,840.70	0.1992
	鹏华 300 指数 C 类 (LOF)	17,256.46	0.1345
	合计	499,097.16	0.1960

注:截至本报告期末,本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

单位:份

项目	鹏华 300 指数 A 类 (LOF)	鹏华 300 指数 C 类 (LOF)
基金合同生效日 (2009 年 4 月 3 日)	1,994,428,997.48	-

基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	249,896,758.18	—
本报告期基金总申购份额	107,397,988.02	35,526,624.12
减：本报告期基金总赎回份额	115,416,054.12	22,699,552.72
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
本报告期期末基金份额总额	241,878,692.08	12,827,071.40

注：1、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。

2、自 2019 年 1 月 22 日起鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）增加 C 类基金份额。

## § 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

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

无

### 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	
国盛证券	1	121,481,667.92	50.03%	98,553.06	46.94%	-
国信证券	2	108,704,379.40	44.77%	99,927.24	47.59%	-
申万宏源	2	9,299,510.77	3.83%	8,474.65	4.04%	本报告期新增一个
国泰君安	1	1,951,261.53	0.80%	1,778.25	0.85%	-
兴业证券	1	1,361,053.14	0.56%	1,240.30	0.59%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券	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 & 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
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

注：无。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	2018 年第四季度报告	《上海证券报》	2019 年 01 月 21 日
2	关于鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）和鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）新增 C 类基金份额并修改基金合同的公告	《中国证券报》	2019 年 01 月 22 日
3	关于鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）和鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）新增 C 类基金份额并修改基金合同的公告	《上海证券报》	2019 年 01 月 22 日
4	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

5	鹏华基金管理有限公司关于在网上直销及直销柜台渠道开展旗下指定货币基金与指数基金、指数基金之间转换费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2019 年 02 月 01 日
6	鹏华基金管理有限公司关于增加中国中投证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 02 月 11 日
7	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
8	鹏华基金管理有限公司关于增加招商证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》	2019 年 02 月 13 日
9	鹏华基金管理有限公司关于增加世纪证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》	2019 年 02 月 19 日
10	鹏华基金管理有限公司关于增加联讯证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》	2019 年 02 月 19 日
11	鹏华基金管理有限公司关于增加南京证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》	2019 年 02 月 21 日
12	鹏华基金管理有限公司关于增加中国银河证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》	2019 年 02 月 21 日
13	鹏华基金管理有限公司关于增加华泰证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》	2019 年 02 月 25 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》	2019 年 02 月 26 日
15	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
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	《证券时报》	2019 年 02 月 26 日
17	鹏华基金管理有限公司关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 02 月 27 日
18	鹏华基金管理有限公司关于增加海银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》	2019 年 02 月 27 日
19	鹏华基金管理有限公司关于增加海银	《上海证券报》	2019 年 02 月 27 日

	基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告		
20	鹏华基金管理有限公司关于增加北京恒天明泽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》	2019 年 02 月 27 日
21	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与方正证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 02 月 28 日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国民族证券有限责任公司申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 02 月 28 日
23	鹏华基金管理有限公司关于增加长江证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 01 日
24	鹏华基金管理有限公司关于增加长江证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 01 日
25	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
26	鹏华基金管理有限公司关于增加财通证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 01 日
27	鹏华基金管理有限公司关于增加财通证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 01 日
28	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》	2019 年 03 月 01 日
29	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》	2019 年 03 月 01 日
30	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
31	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与财通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》	2019 年 03 月 04 日
32	鹏华基金管理有限公司关于增加平安证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 04 日
33	鹏华基金管理有限公司关于增加平安证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 04 日
34	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与财通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	《上海证券报》	2019 年 03 月 04 日
35	鹏华基金管理有限公司关于增加华安证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 05 日

36	鹏华基金管理有限公司关于增加华安证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 05 日
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙商银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019 年 03 月 12 日
38	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙商银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 12 日
39	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙商银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 12 日
40	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
41	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
42	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
43	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
44	鹏华基金管理有限公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019 年 03 月 13 日
45	鹏华基金管理有限公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券日报》	2019 年 03 月 13 日
46	鹏华基金管理有限公司关于增加浙江同花顺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》	2019 年 03 月 13 日
47	鹏华基金管理有限公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 13 日
48	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与方正证券股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 14 日
49	鹏华基金管理有限公司关于增加信达证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 14 日
50	鹏华基金管理有限公司关于增加信达证券股份有限公司为旗下部分基金销	《上海证券报》	2019 年 03 月 14 日



	售机构的公告		
51	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国民族证券有限责任公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 14 日
52	鹏华基金管理有限公司关于增加大同证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 18 日
53	鹏华基金管理有限公司关于增加大同证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 18 日
54	鹏华基金管理有限公司关于增加上海证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 22 日
55	鹏华基金管理有限公司关于增加首创证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019 年 03 月 22 日
56	鹏华基金管理有限公司关于增加上海证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 22 日
57	鹏华基金管理有限公司关于增加首创证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 22 日
58	鹏华基金管理有限公司关于增加首创证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 22 日
59	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国信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	《证券时报》	2019 年 03 月 27 日
60	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国信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	《上海证券报》	2019 年 03 月 27 日
61	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国信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	《证券日报》	2019 年 03 月 27 日
62	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国信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》	2019 年 03 月 27 日
63	2018 年年度报告摘要	《上海证券报》	2019 年 03 月 28 日
64	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	《证券时报》	2019 年 03 月 29 日

	申购 (含定期定额申购) 费率优惠活动的公告		
65	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
66	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
67	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
68	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
69	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
70	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
71	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
72	鹏华基金管理有限公司关于增加五矿证券有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 04 月 01 日
73	鹏华基金管理有限公司关于增加五矿证券有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 04 月 01 日
74	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
75	鹏华基金管理有限公司关于增加北京唐鼎耀华基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2019 年 04 月 11 日
76	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

77	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
78	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
79	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 04 月 13 日
80	2019 年第一季度报告	《上海证券报》	2019 年 04 月 19 日
81	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	《上海证券报》	2019 年 04 月 23 日
82	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》	2019 年 04 月 23 日
83	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	《证券时报》	2019 年 04 月 23 日
84	鹏华基金管理有限公司关于增加国盛证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019 年 04 月 30 日
85	鹏华基金管理有限公司关于增加国盛证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 04 月 30 日
86	鹏华基金管理有限公司关于增加国盛证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 04 月 30 日
87	鹏华基金管理有限公司关于增加国盛证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券日报》	2019 年 04 月 30 日
88	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
89	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
90	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
91	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
92	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资	《证券日报》	2019 年 05 月 13 日

	者及时提供或更新身份信息资料的公告		
93	鹏华基金管理有限公司关于增加上海天天基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019 年 05 月 13 日
94	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
95	鹏华基金管理有限公司关于增加上海天天基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 05 月 13 日
96	鹏华基金管理有限公司关于增加上海天天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》	2019 年 05 月 13 日
97	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
98	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
99	鹏华基金管理有限公司关于增加国金证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 05 月 16 日
100	鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）更新的招募说明书	《上海证券报》	2019 年 05 月 16 日
101	鹏华基金管理有限公司关于增加国金证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 05 月 16 日
102	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
103	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
104	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
105	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
106	鹏华基金管理有限公司关于增加上海挖财基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券日报》	2019 年 05 月 22 日
107	鹏华基金管理有限公司关于增加上海	《证券时报》	2019 年 05 月 22 日

	挖财基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告		
108	鹏华基金管理有限公司关于增加上海挖财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》	2019 年 05 月 22 日
109	鹏华基金管理有限公司关于增加上海挖财基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 05 月 22 日
110	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司旗下部分基金的公告	《证券日报》	2019 年 05 月 22 日
111	鹏华基金管理有限公司关于增加宜信普泽（北京）基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019 年 06 月 17 日
112	鹏华基金管理有限公司关于增加上海好买基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 06 月 17 日
113	鹏华基金管理有限公司关于增加宜信普泽（北京）基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 06 月 17 日
114	鹏华基金管理有限公司关于增加诺亚正行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》	2019 年 06 月 17 日
115	鹏华基金管理有限公司关于增加上海好买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》	2019 年 06 月 17 日
116	鹏华基金管理有限公司关于增加诺亚正行基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 06 月 17 日
117	鹏华基金管理有限公司关于增加上海好买基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券日报》	2019 年 06 月 17 日
118	鹏华基金管理有限公司关于增加诺亚正行基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券日报》	2019 年 06 月 17 日
119	鹏华基金管理有限公司关于增加诺亚正行基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019 年 06 月 17 日
120	鹏华基金管理有限公司关于增加上海好买基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019 年 06 月 17 日
121	鹏华基金管理有限公司关于增加宜信普泽（北京）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》	2019 年 06 月 17 日

122	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
123	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
124	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
125	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
126	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
127	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
128	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
129	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
130	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
131	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
132	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
133	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
134	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《证券日报》	2019 年 06 月 27 日
135	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 06 月 27 日
136	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期	《证券时报》	2019 年 06 月 27 日

	定额申购费率优惠活动的公告		
137	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019 年 06 月 27 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)《鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- (二)《鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- (三)《鹏华沪深 300 指数证券投资基金（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 55 号中国工商银行股份有限公司。

### 12.3 查阅方式

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

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

鹏华基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日