

# 鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 .....	7
2.4 信息披露方式 .....	7
2.5 其他相关资料 .....	8
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	8
3.2 基金净值表现 .....	8
3.3 其他指标 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
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 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
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 .....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表 .....	15
6.2 利润表 .....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	39
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 .....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	51
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 .....	51
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 .....	51

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 .....	52
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 .....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
7.12 投资组合报告附注 .....	52
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	53
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	58
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</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 .....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	鹏华沪深港新兴成长混合
基金主代码	003835
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 2 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	18,543,620.18 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，通过积极灵活的资产配置，并精选新兴成长主题股票，在有效控制风险前提下，力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。</p> <p>2、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘 A 股和港股的优质公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1）自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2）自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。</p> <p>（1）新兴成长主题的定义 本基金所投资的新兴成长主题企业包括传统产业中具备新的成长动力的企业和新兴产业中业绩显著增长的企业。</p> <p>1）传统产业是指在历史上曾经高速增长，但目前发展速度趋缓，进入成熟阶段，资源消耗大和环保水平低的产业。随着我国经济模式的主动和被动调整、新技术的产生、新的商业模式的出现、生产方式的不断升级以及行业并购重组整合的加剧，传统产业中也会不断出现具有成长性、未来发展前景好的公司。发展较为成熟的上市公司，因不断更新生产技术、不断完善经营模式等使其具备良好的成长前景，以及传统产业中涌现的具备新技术、新经营理念的新兴上市公司，均属于本基金的投资主题。</p> <p>2）新兴产业是指以重大技术突破和重大发展需求为基础，对经济社会全局和长远发展具有重大引领带动作用，知识技术密集、物质资源消耗少、成长潜力大、综合效益好的产业。参考国家战略新兴产业选择标准，本基金所指的新兴产业包括但不限于：节能环保、医药生物、新能源材料、军工、互联网、新一代信息技术、医疗健康、新兴消费行</p>

业等。未来如果基金管理人认为有更适当的新兴成长主题的划分标准，基金管理人有权对上述界定方法进行变更。本基金由于上述原因变更界定方法不需经基金份额持有人大会通过，但应及时告知基金托管人并公告。若因基金管理人界定方法的调整等原因导致本基金持有的新兴成长主题的证券的比例低于非现金基金资产的 80%，本基金将在三十个交易日之内进行调整。

(2) 自上而下的行业遴选 本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。

(3) 自下而上的个股选择 本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，精选优质个股。

1) 定性分析 本基金通过以下两方面标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出优质的公司：一方面是竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有核心竞争力，并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。另一方面是管理层分析，通过着重考察公司的管理层以及管理制度，选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。

2) 定量分析 本基金通过对公司定量的估值分析，挖掘优质的投资标的。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法（包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等）；就估值倍数而言，通过业内比较、历史比较和增长性分析，确定具有上升基础的股价水平。

(4) 港股通标的投资策略 除新兴成长主题的投资标的之外，本基金还将关注以下几类港股通标的：1) 在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司；2) 具有行业稀缺性的香港本地和外资公司；3) 港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、股息率等方面具有吸引力的投资标的。

3、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。

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

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

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

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

(5) 个券选择策略 本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率

	<p>曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。（6）信用策略 本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。4、权证投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。5、中小企业私募债投资策略 中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。6、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。</p>
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	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张戈
	联系电话	0755-82825720
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn
客户服务电话	4006788999	010-67595096
传真	0755-82021126	010-66275853
注册地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区金融街 25 号
办公地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	何如	田国立

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号 深圳国际商会中心第 43 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	1,964,971.50
本期利润	1,998,642.18
加权平均基金份额本期利润	0.1098
本期加权平均净值利润率	7.85%
本期基金份额净值增长率	15.59%
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	5,419,348.10
期末可供分配基金份额利润	0.2922
期末基金资产净值	25,977,542.04
期末基金份额净值	1.401
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	40.10%

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

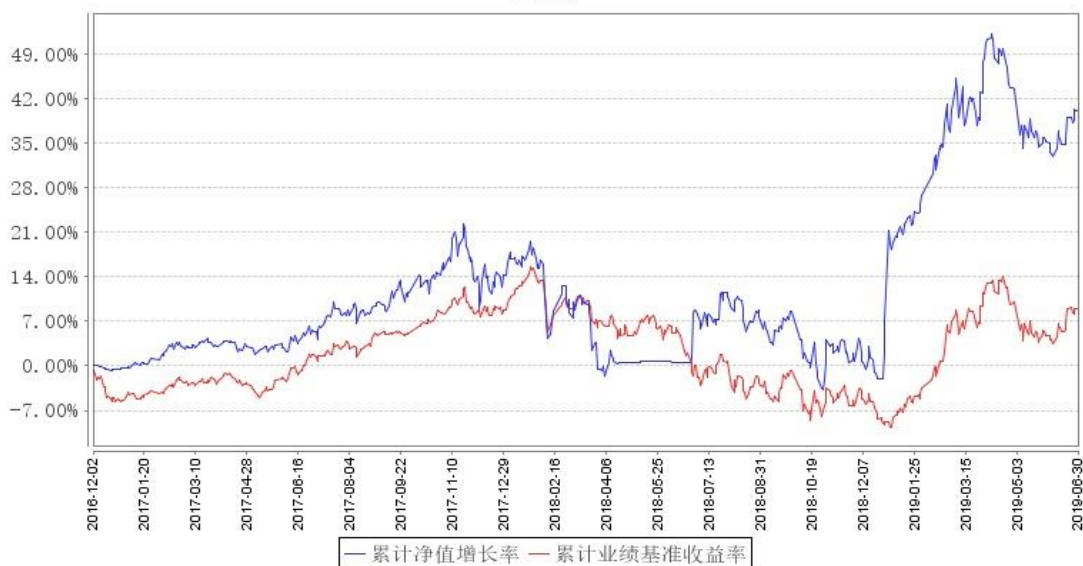


过去一个月	3.55%	0.89%	3.94%	0.81%	-0.39%	0.08%
过去三个月	-2.03%	1.24%	-0.50%	1.06%	-1.53%	0.18%
过去六个月	15.59%	1.29%	19.33%	1.08%	-3.74%	0.21%
过去一年	29.01%	1.55%	8.73%	1.07%	20.28%	0.48%
自基金成立 起至今	40.10%	1.21%	8.91%	0.81%	31.19%	0.40%

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

鹏华沪深港新兴成长混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2016 年 12 月 02 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		
尤柏年	本基金基金经理	2016-12-28	-	15	尤柏年先生，国籍中国，经济学博士，15 年证券基金从业经验。历任澳大利亚 BConnect 公司 Apex 投资咨询团队分析师，华宝兴业基金管理有限公司金融工程部高级数量分析师、海外投资管理部高级分析师、基金经理助理、华宝兴业成熟市场基金和华宝兴业标普油气基金基金经理等职；2014 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任国际业务部副总经理，现担任国际业务部总经理、基金经理。2014 年 08 月担任鹏华全球高收益债基金基金经理，2014 年 09 月担任鹏华环球发现（QDII-FOF）基金基

					<p>金经理，2015 年 07 月担任鹏华前海万科 REITs 基金基金经理，2016 年 12 月担任鹏华沪深港新兴成长混合基金基金经理，2017 年 11 月担任鹏华港美互联股票（LOF）基金基金经理，2017 年 11 月担任鹏华香港银行指数（LOF）基金基金经理，2017 年 11 月担任鹏华香港中小企业指数（LOF）基金基金经理。尤柏年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>
胡东健	本基金基金经理	2016-12-02	2019-07-03	8	<p>胡东健先生，国籍中国，经济学硕士，8 年证券基金从业经验。历任融通基金管理有限公司研究员；2015 年 1 月加盟鹏华基金管理有限公司，担任高级研究员，从事投资研究工作，现任权益投资二部基金经理。2015 年 06 月至 2019 年 04 月担任鹏华价值精选股票基金基金经理，2015 年 12 月至 2017 年 07 月担任鹏华优质治理混合（LOF）基金基金经理，2016 年 12 月至 2019 年 07 月担任鹏华沪深港新兴成长混合基金基金经理，2017 年 04 月至 2018 年 05 月担任鹏华沪深港互联网基金基</p>

					金经理。胡东健先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
--	--	--	--	--	--------------------------------------

注:1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日;担任新成立基金基金经理的,任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金运作合规,不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度,确保不同投资组合在研究、交易、分配各环节得到公平对待。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年,市场较去年年底有所反弹,其中 a 股市场走势强于港股市场。在经历了一季度的快速估值修复之后,二季度港股及国内市场波动加大,先涨后跌再反弹,整体较一季度有所回调。市场行情从一季度的估值修复和资金驱动,转为宏观主导。4 月份各指数继续上行,4 月下旬开始国内政策面和资金面出现边际变化,带动指数进入调整,进入 5 月,中美贸易谈判再次出现波折,市场继续下探。6 月开始,随着中美谈判出现缓和迹象,叠加市场对 G20 会谈出现乐观预期,市场出现恢复性上涨。总体来看,上半年上证综指上涨 19.45%,深圳成指上涨 26.78%。恒生指数上涨 10.43%,恒生国企指数上涨 7.48%。

本基金在上半年采取了一定的择时策略。尤其是在 4 月下旬市场出现边际变化以后,较为及时地降低持仓占比,使得基金在市场回调时候减少了损失。此外,二季度开始,基金满足了新股

线下申购的要求，开始参与新股投资，也对基金净值产生了一定正面贡献。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金期末单位净值为 1.401，累计净值为 1.401，较期初上涨约 15.6%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为市场在外部环境改善的带动下短期内仍会延续反弹，但是宏观经济下行压力仍大，且中美贸易谈判仍存在不确定性，在指数反弹以后，仍需关注宏观经济超预期下行和外部冲击带来的二次探底。行业方面，我们认为在经济下行压力增加的情形下，受益于宏观对冲政策支持的行业有机会出现超额收益，此外受到科创板的带动，优质的科技创新型企业也有上行动力。资金面方面，预计外资仍将持续流入。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

##### (1) 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

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

##### (2) 特殊业务估值流程

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

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同

商定估值原则和政策。

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4、定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 5,419,348.10 元，期末基金份额净值 1.401 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人及相关机构正在就可行的解决方案进行探讨论证。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

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	4,282,492.51	228,656.04
结算备付金		883,659.93	16,221.05
存出保证金		348,761.44	13,238.12
交易性金融资产	6.4.7.2	22,462,960.60	664,552.57
其中：股票投资		22,462,960.60	664,552.57
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		577,245.87	-
应收利息	6.4.7.5	1,286.13	70.00
应收股利		28,800.00	-
应收申购款		43,678.07	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		28,628,884.55	922,737.78
<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		1,246,440.01	0.10
应付赎回款		1,266,101.37	-
应付管理人报酬		13,097.05	378.65
应付托管费		5,457.09	157.77
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	97,497.85	5,334.58
应交税费		205.53	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	22,543.61	35,000.00
负债合计		2,651,342.51	40,871.10
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	18,543,620.18	727,592.28
未分配利润	6.4.7.10	7,433,921.86	154,274.40
所有者权益合计		25,977,542.04	881,866.68
负债和所有者权益总计		28,628,884.55	922,737.78

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.401 元，基金份额总额 18,543,620.18 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		2,535,127.24	-19,990,495.81
1. 利息收入		27,165.85	225,951.39
其中：存款利息收入	6.4.7.11	27,029.31	160,157.56
债券利息收入		136.54	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	65,793.83
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,212,851.34	-10,512,270.72
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,900,128.32	-10,530,890.37
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	12,187.50	-
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	25,042.48	-
股利收益	6.4.7.16	275,493.04	18,619.65
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	33,692.71	-9,797,109.46
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	261,417.34	92,932.98



减：二、费用		536,485.06	2,761,483.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	74,164.78	428,174.50
2. 托管费	6.4.10.2.2	30,901.96	178,405.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	409,171.18	1,927,378.54
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		115.25	-
7. 其他费用	6.4.7.20	22,131.89	227,524.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,998,642.18	-22,751,979.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,998,642.18	-22,751,979.68

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

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）	727,592.28	154,274.40	881,866.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,998,642.18	1,998,642.18
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）	17,816,027.90	5,281,005.28	23,097,033.18
其中：1. 基金申购款	50,559,105.86	18,780,027.42	69,339,133.28
2. 基金赎回款	-32,743,077.96	-13,499,022.14	-46,242,100.10
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者权益(基金净值)	18,543,620.18	7,433,921.86	25,977,542.04
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)	236,096,143.44	33,754,305.80	269,850,449.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-22,751,979.68	-22,751,979.68
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)	-235,642,635.41	-10,963,334.54	-246,605,969.95
其中：1. 基金申购款	16,499,339.68	165,266.79	16,664,606.47
2. 基金赎回款	-252,141,975.09	-11,128,601.33	-263,270,576.42
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)	453,508.03	38,991.58	492,499.61

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

鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2638号《关于准予鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。

本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 430,388,047.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1599 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 430,388,068.84 份基金份额，其中认购资金利息折合 21.84 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%—95%（其中投资于国内依法发行的股票的比例占基金资产的 0—95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0—95%）；投资于新兴成长主题的公司发行的证券占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×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》、《鹏华沪深港新兴成长灵活配置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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2019 年上半年内，本基金出现连续 60 个

工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍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

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利, H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请,由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利,由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	4,282,492.51
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	4,282,492.51

## 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	22,466,061.15	22,462,960.60	-3,100.55
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	22,466,061.15	22,462,960.60	-3,100.55

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	2,115,740.00	-	-	
其中：股指期货投资	2,115,740.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	2,115,740.00	-	-	

注：（1）衍生金融资产项下的期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

（2）截止本报告期末，本基金持有 IC1907 合约 1 张，合约市值为人民币 981,280.00 元；本基金持有 IF1907 合约 1 张，合约市值为人民币 1,141,500.00 元。

## 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	863.53
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	391.35
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	31.25
合计	1,286.13

## 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	97,497.85
银行间市场应付交易费用	-
合计	97,497.85

## 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	2,707.82
预提费用	19,835.79
合计	22,543.61

## 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	727,592.28	727,592.28
本期申购	50,559,105.86	50,559,105.86
本期赎回（以“-”号填列）	-32,743,077.96	-32,743,077.96
- 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	18,543,620.18	18,543,620.18

注：总申购份额含红利再投。

## 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	163,368.66	-9,094.26	154,274.40
本期利润	1,964,971.50	33,670.68	1,998,642.18
本期基金份额交易产生的变动数	3,291,007.94	1,989,997.34	5,281,005.28
其中：基金申购款	12,530,346.38	6,249,681.04	18,780,027.42
基金赎回款	-9,239,338.44	-4,259,683.70	-13,499,022.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,419,348.10	2,014,573.76	7,433,921.86

## 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	
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		5,491.45
其他		368.71
合计		27,029.31

## 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	
减：卖出股票成本总额		106,399,631.54
买卖股票差价收入		1,900,128.32



## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	12,187.50
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	12,187.50

## 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	683,327.46
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	671,000.00
减：应收利息总额	139.96
买卖债券差价收入	12,187.50

## 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

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出权证成交总额	17,695.96
减:卖出权证成本总额	-
减:买卖权证差价收入应缴纳 增值税额	515.42
买卖权证差价收入	17,180.54

## 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位:人民币元

项目	本期收益金额 2019年1月1日至2019年6月30日
股指期货投资收益	7,861.94

## 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	275,493.04
基金投资产生的股利收益	-
合计	275,493.04

## 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	26,836.21
股票投资	26,836.21

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	7,040.00
权证投资	-
期货	7,040.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	183.50
合计	33,692.71

#### 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	261,417.34
合计	261,417.34

#### 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	409,171.18
银行间市场交易费用	-
合计	409,171.18

#### 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	19,835.79
信息披露费	-
银行汇划费用	2,296.10
合计	22,131.89

#### 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
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人

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	-	-	54,175,995.02	5.27

#### 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

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	-	-	-	-
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	54,175.83	5.51	-	-

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

债券及回购交易免费并不计交易佣金，其所计提的债券及回购买卖经手费、证管费及证券结算风险金均由基金资产承担。

(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	74,164.78	428,174.50
其中：支付销售机构的客户维护费	31,967.12	352.09

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 0.60%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.60%÷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	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	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	30,901.96	178,405.99

注:支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费年费率为 0.25%,逐日计提,按月支付。

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注:无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:无。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资及持有本基金份额。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		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
中国建设银行	4,282,492.51	21,169.15	16,375,594.27	120,518.95

#### 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

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

注:无。

##### 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

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,将风险控制在可承受的范围内。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券的发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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，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	4,282,492.51	-	-	-	4,282,492.51
结算备付金	883,659.93	-	-	-	883,659.93
存出保证金	348,761.44	-	-	-	348,761.44
交易性金融资产	-	-	-	22,462,960.60	22,462,960.60
应收利息	-	-	-	1,286.13	1,286.13
应收股利	-	-	-	28,800.00	28,800.00
应收申购款	-	-	-	43,678.07	43,678.07
应收证券清算款	-	-	-	577,245.87	577,245.87
资产总计	5,514,913.88	-	-	23,113,970.67	28,628,884.55

负债					
应付赎回款	-	-	-	1,266,101.37	1,266,101.37
应付管理人报酬	-	-	-	13,097.05	13,097.05
应付托管费	-	-	-	5,457.09	5,457.09
应付证券清算款	-	-	-	1,246,440.01	1,246,440.01
应付交易费用	-	-	-	97,497.85	97,497.85
应交税费	-	-	-	205.53	205.53
其他负债	-	-	-	22,543.61	22,543.61
负债总计	-	-	-	2,651,342.51	2,651,342.51
利率敏感度缺口	5,514,913.88	-	-	20,462,628.16	25,977,542.04
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	228,656.04	-	-	-	228,656.04
结算备付金	16,221.05	-	-	-	16,221.05
存出保证金	13,238.12	-	-	-	13,238.12
交易性金融资产	-	-	-	664,552.57	664,552.57
应收利息	-	-	-	70.00	70.00
资产总计	258,115.21	-	-	664,622.57	922,737.78
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	378.65	378.65
应付托管费	-	-	-	157.77	157.77
应付证券清算款	-	-	-	0.10	0.10
应付交易费用	-	-	-	5,334.58	5,334.58
其他负债	-	-	-	35,000.00	35,000.00
负债总计	-	-	-	40,871.10	40,871.10
利率敏感度缺口	258,115.21	-	-	623,751.47	881,866.68

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险进行监控。

## 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	4,590,681.64	-	4,590,681.64
资产合计	-	4,590,681.64	-	4,590,681.64
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞口净额	-	4,590,681.64	-	4,590,681.64
项目	上年度末 2018年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	457,962.57	-	457,962.57
资产合计	-	457,962.57	-	457,962.57
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞口净额	-	457,962.57	-	457,962.57

## 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	229,534.08	22,898.13
	所有外币相对人民币贬值 5%	-229,534.08	-22,898.13

#### 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。本基金股票资产占基金资产的比例为 0%—95%；投资于新兴成长主题的公司发行的证券占非现金基金资产的比例不低于 80%，基金持有全部权证的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	22,462,960.60	86.47	664,552.57	75.36
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	22,462,960.60	86.47	664,552.57	75.36

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%	886,495.51	26,156.88
	业绩比较基准下降 5%	-886,495.51	-26,156.88

#### 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	22,462,960.60	78.46
	其中：股票	22,462,960.60	78.46
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	5,166,152.44	18.05
8	其他各项资产	999,771.51	3.49
9	合计	28,628,884.55	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 4,590,681.64 元，占净值比为 17.67%。

## 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	-	-
B	采矿业	18,168.90	0.07
C	制造业	10,603,826.17	40.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	64,800.00	0.25
E	建筑业	396,280.00	1.53
F	批发和零售业	539,018.00	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	647,225.00	2.49
H	住宿和餐饮业	719,200.00	2.77
I	信息传输、软件和信息技术服务业	687,348.64	2.65
J	金融业	3,522,032.25	13.56
K	房地产业	255,200.00	0.98
L	租赁和商务服务业	303,480.00	1.17
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	115,700.00	0.45
S	综合	-	-
	合计	17,872,278.96	68.80

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	28,764.88	0.11
工业	1,046,443.54	4.03
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-

金融	1,451,790.86	5.59
信息技术	2,063,682.36	7.94
通讯服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
电信服务	-	-
非周期性消费品	-	-
工业	-	-
公用事业	-	-
金融	-	-
能源	-	-
信息科技	-	-
医疗	-	-
原材料	-	-
周期性消费品	-	-
合计	4,590,681.64	17.67

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 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	00700	腾讯控股	6,000	1,861,008.70	7.16
2	600030	中信证券	35,000	833,350.00	3.21
2	06030	中信证券	30,000	429,625.94	1.65
3	601992	金隅集团	300,000	1,128,000.00	4.34
4	002304	洋河股份	9,000	1,094,040.00	4.21
5	601288	农业银行	300,000	1,080,000.00	4.16
6	000333	美的集团	20,000	1,037,200.00	3.99
7	06066	中信建投证券	200,000	1,022,164.92	3.93
8	600196	复星医药	40,000	1,012,000.00	3.90
9	600887	伊利股份	30,000	1,002,300.00	3.86
10	01055	中国南方航空股份	100,000	478,535.04	1.84
10	600029	南方航空	50,000	386,000.00	1.49
11	000858	五粮液	7,000	825,650.00	3.18
12	000401	冀东水泥	45,000	792,450.00	3.05
13	600258	首旅酒店	40,000	719,200.00	2.77
14	600519	贵州茅台	700	688,800.00	2.65
15	601998	中信银行	100,000	597,000.00	2.30
16	02382	舜宇光学科技	8,000	567,908.50	2.19
17	000538	云南白药	6,000	500,520.00	1.93



18	002475	立讯精密	20,000	495,800.00	1.91
19	000895	双汇发展	18,000	448,020.00	1.72
20	601336	新华保险	7,075	389,337.25	1.50
21	603517	绝味食品	10,000	389,100.00	1.50
22	600050	中国联通	60,000	369,600.00	1.42
23	601318	中国平安	3,500	310,135.00	1.19
24	002127	南极电商	27,000	303,480.00	1.17
25	002384	东山精密	20,000	291,400.00	1.12
26	000963	华东医药	10,800	280,368.00	1.08
27	000423	东阿阿胶	7,000	278,740.00	1.07
28	601800	中国交建	24,000	271,680.00	1.05
29	603713	密尔克卫	7,500	261,225.00	1.01
30	601601	中国太保	7,000	255,570.00	0.98
31	600048	保利地产	20,000	255,200.00	0.98
32	601933	永辉超市	20,000	204,200.00	0.79
33	00354	中国软件国际	60,000	202,673.66	0.78
34	002405	四维图新	10,500	169,050.00	0.65
35	000400	许继电气	16,000	144,960.00	0.56
36	300003	乐普医疗	6,000	138,120.00	0.53
37	300059	东方财富	10,000	135,500.00	0.52
38	603589	口子窖	2,000	128,840.00	0.50
39	000786	北新建材	7,000	126,910.00	0.49
40	600068	葛洲坝	20,000	124,600.00	0.48
41	300144	宋城演艺	5,000	115,700.00	0.45
42	000100	TCL 集团	20,000	66,600.00	0.26
43	600578	京能电力	20,000	64,800.00	0.25
44	601628	中国人寿	2,000	56,640.00	0.22
45	601607	上海医药	3,000	54,450.00	0.21
46	00691	山水水泥	10,000	28,764.88	0.11
47	600968	海油发展	5,118	18,168.90	0.07
48	603867	新化股份	557	14,376.17	0.06
49	601698	中国卫通	3,367	13,198.64	0.05

## 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	00700	腾讯控股	4,381,247.90	496.82
2	06066	中信建投证券	3,056,523.23	346.60
3	000401	冀东水泥	2,530,250.00	286.92
4	00763	中兴通讯	2,525,237.79	286.35
5	002304	洋河股份	2,315,852.44	262.61

6	000063	中兴通讯	2,216,719.00	251.37
7	300170	汉得信息	2,137,676.00	242.40
8	600111	北方稀土	2,022,535.00	229.35
9	600196	复星医药	2,004,239.32	227.27
10	600073	上海梅林	1,940,978.74	220.10
11	601992	金隅集团	1,938,130.00	219.78
12	600048	保利地产	1,811,029.00	205.36
13	002236	大华股份	1,810,275.00	205.28
14	000002	万科A	1,799,031.37	204.00
15	600887	伊利股份	1,587,993.00	180.07
16	000858	五粮液	1,573,270.00	178.40
17	000983	西山煤电	1,565,524.00	177.52
18	01638	佳兆业集团	1,559,541.32	176.85
19	601288	农业银行	1,499,010.00	169.98
20	300017	网宿科技	1,493,308.00	169.33
21	01336	新华保险	1,482,643.56	168.13
22	002624	完美世界	1,477,437.00	167.54
23	603517	绝味食品	1,449,164.50	164.33
24	00880	澳博控股	1,429,036.66	162.05
25	00762	中国联通	1,412,269.54	160.15
26	000732	泰禾集团	1,378,776.40	156.35
27	00288	万洲国际	1,366,830.64	154.99
28	00563	上实城市开发	1,359,279.45	154.14
29	601998	中信银行	1,303,000.00	147.75
30	603197	保隆科技	1,291,271.40	146.42
31	000333	美的集团	1,261,720.00	143.07
32	002415	海康威视	1,159,826.00	131.52
33	02208	金风科技	1,136,436.72	128.87
34	002398	建研集团	1,112,418.94	126.14
35	601611	中国核建	1,103,921.00	125.18
36	00966	中国太平	1,088,240.11	123.40
37	00691	山水水泥	1,076,596.70	122.08
38	600029	南方航空	1,046,653.00	118.69
39	002127	南极电商	1,022,753.00	115.98
40	000651	格力电器	1,001,737.00	113.59
41	600977	中国电影	1,000,171.00	113.42
42	03323	中国建材	999,459.11	113.33
43	603993	洛阳钼业	984,200.00	111.60
44	300168	万达信息	982,539.00	111.42
45	300498	温氏股份	980,172.00	111.15
46	02001	新高教集团	955,679.47	108.37
47	600718	东软集团	950,189.00	107.75

48	600352	浙江龙盛	944,300.00	107.08
49	00285	比亚迪电子	927,976.14	105.23
50	01813	合景泰富集团	927,388.02	105.16
51	002384	东山精密	898,208.00	101.85
52	600050	中国联通	893,700.00	101.34
53	03377	远洋集团	885,649.46	100.43
54	00895	东江环保	867,685.58	98.39
55	600699	均胜电子	843,321.00	95.63
56	002508	老板电器	801,800.00	90.92
57	06030	中信证券	800,403.15	90.76
58	601009	南京银行	796,019.00	90.27
59	600030	中信证券	792,891.00	89.91
60	600622	光大嘉宝	779,512.00	88.39
61	03888	金山软件	774,412.32	87.82
62	600809	山西汾酒	774,146.00	87.78
63	000977	浪潮信息	736,429.29	83.51
64	601336	新华保险	716,148.00	81.21
65	00354	中国软件国际	695,028.27	78.81
66	600258	首旅酒店	682,430.00	77.38
67	000423	东阿阿胶	680,835.00	77.20
68	603713	密尔克卫	677,925.00	76.87
69	600519	贵州茅台	659,054.00	74.73
70	01970	IMAX CHINA	657,208.91	74.52
71	600373	中文传媒	653,525.00	74.11
72	601318	中国平安	646,616.00	73.32
73	00665	海通国际	643,732.29	73.00
74	01234	中国利郎	621,037.51	70.42
75	002847	盐津铺子	589,405.00	66.84
76	300454	深信服	582,472.00	66.05
77	02628	中国人寿	568,712.34	64.49
78	01347	华虹半导体	566,917.41	64.29
79	02382	舜宇光学科技	563,436.80	63.89
80	02388	中银香港	563,380.07	63.88
81	600426	华鲁恒升	562,197.00	63.75
82	601328	交通银行	545,604.00	61.87
83	300770	新媒股份	540,947.95	61.34
84	000538	云南白药	526,213.00	59.67
85	03383	雅居乐集团	508,034.87	57.61
86	000895	双汇发展	495,835.00	56.23
87	03311	中国建筑国际	488,452.87	55.39
88	00011	恒生银行	486,308.25	55.15
89	01055	中国南方航空股	478,722.89	54.29

		份		
90	000100	TCL 集团	477,913.00	54.19
91	600060	海信电器	473,440.00	53.69
92	002475	立讯精密	472,738.00	53.61
93	603357	设计总院	470,339.00	53.33
94	03933	联邦制药	463,731.03	52.59
95	002456	欧菲光	455,694.00	51.67
96	002572	索菲亚	449,848.52	51.01
97	601012	隆基股份	444,544.00	50.41
98	00189	东岳集团	443,663.15	50.31
99	00337	绿地香港	443,634.62	50.31
100	601001	大同煤业	442,750.00	50.21
101	000560	我爱我家	436,046.00	49.45
102	600585	海螺水泥	428,700.00	48.61
103	01313	华润水泥控股	428,602.40	48.60
104	600312	平高电气	423,360.00	48.01
105	300003	乐普医疗	422,723.00	47.94
106	00384	中国燃气	414,709.81	47.03
107	03618	重庆农村商业银行	412,688.40	46.80
108	02238	广汽集团	412,321.86	46.76
109	000915	山大华特	411,854.00	46.70
110	601111	中国国航	397,303.00	45.05
111	600325	华发股份	393,000.00	44.56
112	01999	敏华控股	391,694.33	44.42
113	601899	紫金矿业	363,000.00	41.16
114	600115	东方航空	362,029.52	41.05
115	002174	游族网络	347,071.00	39.36
116	00175	吉利汽车	346,919.79	39.34
117	603369	今世缘	335,717.00	38.07
118	000963	华东医药	319,398.00	36.22
119	002468	申通快递	316,364.00	35.87
120	002463	沪电股份	307,887.00	34.91
121	01569	民生教育	302,945.79	34.35
122	00119	保利置业集团	298,875.24	33.89
123	002142	宁波银行	294,993.98	33.45
124	01888	建滔积层板	285,555.03	32.38
125	000069	华侨城 A	279,400.00	31.68
126	02233	西部水泥	277,392.60	31.46
127	300474	景嘉微	276,533.00	31.36
128	01788	国泰君安国际	275,754.87	31.27
129	601800	中国交建	275,520.00	31.24

130	300568	星源材质	268,623.00	30.46
131	00753	中国国航	259,552.93	29.43
132	601601	中国太保	252,466.00	28.63
133	000088	盐田港	248,000.00	28.12
134	02009	金隅集团	247,973.85	28.12
135	002234	民和股份	243,015.00	27.56
136	03339	中国龙工	241,962.17	27.44
137	01610	中粮肉食	239,978.64	27.21
138	00998	中信银行	239,609.11	27.17
139	300207	欣旺达	239,408.00	27.15
140	02357	中航科工	235,336.75	26.69
141	02018	瑞声科技	232,769.44	26.40
142	01658	邮储银行	223,502.29	25.34
143	601021	春秋航空	218,640.00	24.79
144	00390	中国中铁	215,395.83	24.42
145	002129	中环股份	196,832.00	22.32
146	02333	长城汽车	193,164.40	21.90
147	601933	永辉超市	189,800.00	21.52
148	601233	桐昆股份	182,500.00	20.69
149	600038	中直股份	181,120.00	20.54
150	002405	四维图新	177,940.00	20.18
151	01238	宝龙地产	172,211.82	19.53
152	600004	白云机场	172,158.00	19.52
153	03380	龙光地产	171,587.52	19.46
154	600845	宝信软件	170,213.00	19.30
155	01093	石药集团	168,749.50	19.14
156	601988	中国银行	167,700.00	19.02
157	600068	葛洲坝	152,600.00	17.30
158	02318	中国平安	152,061.39	17.24
159	01988	民生银行	150,040.33	17.01
160	000876	新希望	147,827.00	16.76
161	000400	许继电气	147,012.00	16.67
162	00867	康哲药业	146,458.15	16.61
163	601088	中国神华	143,640.00	16.29
164	002233	塔牌集团	143,200.00	16.24
165	03808	中国重汽	141,598.05	16.06
166	000786	北新建材	139,860.00	15.86
167	300059	东方财富	137,400.00	15.58
168	600989	宝丰能源	135,419.36	15.36
169	01072	东方电气	135,111.41	15.32
170	01963	重庆银行	134,478.24	15.25
171	603589	口子窖	132,420.00	15.02

172	03908	中金公司	131,586.98	14.92
173	600104	上汽集团	130,693.00	14.82
174	06818	中国光大银行	126,734.06	14.37
175	603583	捷昌驱动	123,733.00	14.03
176	002507	涪陵榨菜	117,619.00	13.34
177	002366	台海核电	116,500.00	13.21
178	300144	宋城演艺	111,643.00	12.66
179	00751	创维数码	103,655.30	11.75
180	01458	周黑鸭	101,295.59	11.49
181	00590	六福集团	97,798.17	11.09
182	02601	中国太保	86,273.15	9.78
183	000776	广发证券	80,000.00	9.07
184	600019	宝钢股份	78,200.00	8.87
185	000783	长江证券	75,000.00	8.50
186	600919	江苏银行	71,700.00	8.13
187	002377	国创高新	71,600.00	8.12
188	001979	招商蛇口	69,180.00	7.84
189	02007	碧桂园	67,430.48	7.65
190	600578	京能电力	66,800.00	7.57
191	601628	中国人寿	61,760.00	7.00
192	06837	海通证券	59,779.63	6.78
193	601607	上海医药	59,490.00	6.75
194	000166	申万宏源	54,900.00	6.23
195	601898	中煤能源	54,800.00	6.21
196	02689	玖龙纸业	51,882.11	5.88
197	002008	大族激光	41,660.00	4.72
198	02799	中国华融	38,306.54	4.34
199	002024	苏宁易购	37,350.00	4.24
200	002955	鸿合科技	34,800.24	3.95
201	000600	建投能源	32,880.00	3.73
202	601166	兴业银行	30,620.00	3.47
203	03968	招商银行	25,339.24	2.87
204	01030	新城发展控股	18,901.23	2.14

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	00763	中兴通讯	2,838,604.20	321.89
2	00700	腾讯控股	2,671,473.38	302.93
3	000063	中兴通讯	2,218,775.00	251.60
4	300170	汉得信息	1,973,586.00	223.80

5	600111	北方稀土	1,928,266.00	218.66
6	002236	大华股份	1,887,356.00	214.02
7	06066	中信建投证券	1,879,671.09	213.15
8	600073	上海梅林	1,838,371.00	208.46
9	000401	冀东水泥	1,793,439.00	203.37
10	000002	万科A	1,777,081.00	201.51
11	01638	佳兆业集团	1,734,554.43	196.69
12	002624	完美世界	1,563,762.00	177.32
13	600352	浙江龙盛	1,563,311.00	177.27
14	600048	保利地产	1,538,955.00	174.51
15	01336	新华保险	1,492,512.24	169.24
16	00762	中国联通	1,478,075.79	167.61
17	000983	西山煤电	1,470,147.00	166.71
18	000732	泰禾集团	1,461,648.00	165.74
19	00288	万洲国际	1,424,059.66	161.48
20	300017	网宿科技	1,412,054.26	160.12
21	00563	上实城市开发	1,383,887.79	156.93
22	00880	澳博控股	1,363,914.33	154.66
23	603197	保隆科技	1,287,646.00	146.01
24	601611	中国核建	1,272,718.00	144.32
25	603517	绝味食品	1,254,483.90	142.25
26	002304	洋河股份	1,206,223.00	136.78
27	00691	山水水泥	1,197,292.48	135.77
28	02208	金风科技	1,176,785.83	133.44
29	002398	建研集团	1,160,372.00	131.58
30	00966	中国太平	1,153,646.88	130.82
31	002415	海康威视	1,125,403.95	127.62
32	000651	格力电器	1,032,144.00	117.04
33	01813	合景泰富集团	1,025,517.28	116.29
34	03323	中国建材	1,013,389.15	114.91
35	000858	五粮液	1,005,967.00	114.07
36	300168	万达信息	1,001,068.00	113.52
37	600977	中国电影	963,117.88	109.21
38	000977	浪潮信息	956,861.00	108.50
39	03377	远洋集团	945,753.31	107.24
40	600718	东软集团	922,659.82	104.63
41	03888	金山软件	892,062.63	101.16
42	603993	洛阳钼业	887,300.00	100.62
43	02001	新高教集团	876,617.73	99.40
44	00285	比亚迪电子	866,455.38	98.25
45	600809	山西汾酒	861,786.00	97.72
46	601992	金隅集团	855,360.00	96.99

47	00895	东江环保	843,148.01	95.61
48	300498	温氏股份	836,068.00	94.81
49	002508	老板电器	796,256.00	90.29
50	601009	南京银行	789,445.00	89.52
51	600196	复星医药	789,416.00	89.52
52	600699	均胜电子	786,010.00	89.13
53	600622	光大嘉宝	710,467.00	80.56
54	002127	南极电商	708,661.00	80.36
55	002384	东山精密	703,745.00	79.80
56	01234	中国利郎	684,902.28	77.67
57	600887	伊利股份	677,687.00	76.85
58	01970	IMAX CHINA	671,346.93	76.13
59	00665	海通国际	656,861.96	74.49
60	600029	南方航空	656,040.00	74.39
61	00337	绿地香港	653,381.31	74.09
62	300770	新媒股份	630,420.00	71.49
63	600373	中文传媒	628,398.00	71.26
64	600060	海信电器	607,483.00	68.89
65	601998	中信银行	603,000.00	68.38
66	03383	雅居乐集团	599,651.46	68.00
67	01347	华虹半导体	595,299.78	67.50
68	300454	深信服	562,749.20	63.81
69	02388	中银香港	559,363.85	63.43
70	601328	交通银行	553,520.00	62.77
71	02628	中国人寿	548,170.10	62.16
72	002847	盐津铺子	540,078.00	61.24
73	000915	山大华特	537,681.00	60.97
74	00354	中国软件国际	532,182.55	60.35
75	03311	中国建筑国际	517,098.63	58.64
76	603357	设计总院	492,200.00	55.81
77	600426	华鲁恒升	491,803.00	55.77
78	00011	恒生银行	488,397.91	55.38
79	000100	TCL 集团	457,660.00	51.90
80	600325	华发股份	449,500.00	50.97
81	000560	我爱我家	444,161.80	50.37
82	03933	联邦制药	440,404.55	49.94
83	601012	隆基股份	433,120.00	49.11
84	00384	中国燃气	423,194.13	47.99
85	01313	华润水泥控股	420,716.34	47.71
86	600050	中国联通	414,000.00	46.95
87	600585	海螺水泥	410,000.00	46.49
88	02238	广汽集团	406,773.71	46.13



89	03618	重庆农村商业 银行	406,263.56	46.07
90	601336	新华保险	405,748.25	46.01
91	002572	索菲亚	404,778.00	45.90
92	00189	东岳集团	404,400.36	45.86
93	06030	中信证券	396,328.00	44.94
94	00119	保利置业集团	392,247.51	44.48
95	601111	中国国航	387,180.00	43.90
96	01999	敏华控股	374,796.64	42.50
97	601001	大同煤业	370,918.00	42.06
98	600312	平高电气	369,600.00	41.91
99	600115	东方航空	363,555.00	41.23
100	601288	农业银行	362,500.00	41.11
101	002174	游族网络	359,035.00	40.71
102	000423	东阿阿胶	350,600.00	39.76
103	00175	吉利汽车	345,676.45	39.20
104	601899	紫金矿业	344,000.00	39.01
105	601318	中国平安	338,984.00	38.44
106	01569	民生教育	333,622.13	37.83
107	603369	今世缘	330,723.00	37.50
108	002463	沪电股份	321,000.00	36.40
109	01610	中粮肉食	301,008.36	34.13
110	02233	西部水泥	300,977.28	34.13
111	002142	宁波银行	299,260.00	33.93
112	002468	申通快递	291,337.00	33.04
113	002234	民和股份	290,568.00	32.95
114	02009	金隅集团	288,981.66	32.77
115	000069	华侨城 A	288,400.00	32.70
116	300474	景嘉微	282,128.00	31.99
117	002456	欧菲光	268,529.00	30.45
118	300207	欣旺达	267,800.00	30.37
119	300003	乐普医疗	266,270.00	30.19
120	01888	建滔积层板	261,778.32	29.68
121	01788	国泰君安国际	261,134.28	29.61
122	000088	盐田港	260,533.00	29.54
123	603713	密尔克卫	256,717.00	29.11
124	00753	中国国航	245,733.74	27.87
125	00998	中信银行	243,497.83	27.61
126	03339	中国龙工	240,650.01	27.29
127	000333	美的集团	238,800.00	27.08
128	01658	邮储银行	236,717.83	26.84
129	300568	星源材质	227,131.00	25.76

130	02357	中航科工	226,752.55	25.71
131	02018	瑞声科技	226,014.45	25.63
132	002129	中环股份	221,980.00	25.17
133	01238	宝龙地产	213,071.80	24.16
134	00390	中国中铁	207,603.89	23.54
135	601021	春秋航空	202,627.00	22.98
136	02318	中国平安	196,899.02	22.33
137	002233	塔牌集团	192,320.00	21.81
138	600989	宝丰能源	191,140.00	21.67
139	600038	中直股份	189,621.00	21.50
140	02333	长城汽车	182,649.21	20.71
141	03380	龙光地产	181,763.00	20.61
142	03808	中国重汽	170,302.16	19.31
143	601233	桐昆股份	168,600.00	19.12
144	600004	白云机场	165,490.00	18.77
145	601988	中国银行	163,400.00	18.53
146	03908	中金公司	161,318.53	18.29
147	01093	石药集团	158,606.99	17.99
148	600845	宝信软件	153,908.00	17.45
149	01988	民生银行	151,733.79	17.21
150	603583	捷昌驱动	141,727.12	16.07
151	01072	东方电气	141,360.56	16.03
152	601088	中国神华	141,158.00	16.01
153	01963	重庆银行	139,422.32	15.81
154	00867	康哲药业	135,997.24	15.42
155	000876	新希望	130,800.00	14.83
156	06818	中国光大银行	128,325.94	14.55
157	600104	上汽集团	123,810.00	14.04
158	002366	台海核电	123,200.00	13.97
159	002507	涪陵榨菜	121,978.00	13.83
160	00751	创维数码	104,589.38	11.86
161	00590	六福集团	96,251.39	10.91
162	01458	周黑鸭	90,780.90	10.29
163	02601	中国太保	87,388.51	9.91
164	000776	广发证券	81,500.00	9.24
165	000783	长江证券	76,800.00	8.71
166	02007	碧桂园	76,241.44	8.65
167	600919	江苏银行	72,300.00	8.20
168	600019	宝钢股份	68,000.00	7.71
169	001979	招商蛇口	65,610.00	7.44
170	002377	国创高新	65,000.00	7.37
171	06837	海通证券	59,120.34	6.70

172	000166	申万宏源	55,200.00	6.26
173	02689	玖龙纸业	53,994.46	6.12
174	601898	中煤能源	48,300.00	5.48
175	002955	鸿合科技	45,478.88	5.16
176	002008	大族激光	42,140.00	4.78
177	002024	苏宁易购	41,010.00	4.65
178	01030	新城发展控股	40,822.39	4.63
179	02799	中国华融	39,038.40	4.43
180	02777	富力地产	38,052.90	4.32
181	000600	建投能源	34,366.00	3.90
182	603068	博通集成	33,702.00	3.82
183	02328	中国财险	33,358.05	3.78
184	601166	兴业银行	31,040.00	3.52
185	00884	旭辉控股集团	27,855.17	3.16
186	03968	招商银行	26,849.74	3.04
187	00257	中国光大国际	26,226.19	2.97
188	603317	天味食品	25,102.00	2.85
189	603327	福蓉科技	24,837.12	2.82
190	603982	泉峰汽车	24,718.82	2.80
191	002191	劲嘉股份	21,816.00	2.47
192	300777	中简科技	20,584.22	2.33
193	03898	中车时代电气	19,107.22	2.17
194	00696	中国民航信息 网络	19,063.99	2.16
195	603217	元利科技	17,655.84	2.00

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	128,171,203.36
卖出股票收入(成交)总额	108,299,759.86

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注:无。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:无。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:无。

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

注:无。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注:无。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代 码	名 称	持仓量 (买/ 卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC1907	IC1907	1	981,280.00	-8,200.00	-
IF1907	IF1907	1	1,141,500.00	15,240.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					7,040.00
股指期货投资本期收益 (元)					7,861.94
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					7,040.00

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

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

**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**

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

**7.11.2 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**

注: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	348,761.44
2	应收证券清算款	577,245.87
3	应收股利	28,800.00
4	应收利息	1,286.13
5	应收申购款	43,678.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	999,771.51

#### 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 (%)
2,154	8,608.92	808,794.29	4.36	17,734,825.89	95.64

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	146,024.51	0.7875

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。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

注:截至本报告期末,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。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 12 月 2 日） 基金份额总额	430,388,068.84
本报告期期初基金份额总额	727,592.28
本报告期基金总申购份额	50,559,105.86
减：本报告期基金总赎回份额	32,743,077.96
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	18,543,620.18

注：总申购份额含红利再投。

## § 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。

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 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	
银河证券	2	131,111,397.80	55.54%	127,335.77	57.10%	-
天风证券	1	29,855,232.09	12.65%	27,208.00	12.20%	-
广发证券	2	24,170,195.93	10.24%	22,026.27	9.88%	-
中投证券	1	20,214,709.78	8.56%	18,421.34	8.26%	-
方正证券	2	10,989,882.35	4.66%	10,014.93	4.49%	-
兴业证券	3	7,197,636.95	3.05%	6,559.21	2.94%	本报告期新增1个
长江证券	1	3,894,162.00	1.65%	3,548.84	1.59%	-
瑞信方正	1	3,529,790.00	1.50%	3,216.73	1.44%	-
华泰证券	1	3,167,903.88	1.34%	2,886.86	1.29%	-
平安证券	2	1,942,682.12	0.82%	1,770.25	0.79%	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	本报告期内注销1个

光大证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
中信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注:交易单元选择的标准和程序:

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

- (1) 实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币;
- (2) 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;
- (3) 经营行为规范,最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚;
- (4) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需,并能为本基金提供全面的信息服;

(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
银河证券	8,700.80	1.27%	-	-	-	-
天风证券	629,742.60	92.18%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	28,708.19	4.20%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
华泰证券	16,044.00	2.35%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
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	鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2019年01月12日
2	2018年第四季度报告	《证券时报》	2019年01月21日
3	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
4	关于鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、赎回和定期定额投资业务的公告	《证券时报》	2019年01月29日
5	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》、《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申万宏源证券有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019年02月11日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与申万宏源证券有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019年02月11日
8	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
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》	2019年02月26日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》	2019年02月26日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提	《证券时报》	2019年02月26日

	示性公告		
12	关于鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购和定期定额投资业务的公告	《证券时报》	2019 年 02 月 27 日
13	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》	2019 年 03 月 01 日
14	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》	2019 年 03 月 01 日
15	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
16	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
17	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
18	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
19	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
20	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
21	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
22	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
23	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
24	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
25	2018 年年度报告摘要	《证券时报》	2019 年 03 月 28 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	《证券时报》	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	《证券日报》	2019 年 04 月 13 日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提	《中国证券报》	2019 年 04 月 13 日

	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	《上海证券报》	2019 年 04 月 13 日
31	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在直销柜台渠道开展申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019 年 04 月 15 日
32	鹏华基金管理有限公司关于增加蚂蚁（杭州）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 17 日
33	关于鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、赎回和定期定额投资业务的公告	《证券时报》	2019 年 04 月 17 日
34	2019 年第一季度报告	《证券时报》	2019 年 04 月 19 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	《中国证券报》	2019 年 05 月 07 日
36	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
37	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
38	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
39	关于鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、赎回和定期定额投资业务的公告	《证券时报》	2019 年 05 月 09 日
40	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
41	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
42	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
43	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
44	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

45	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
46	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
47	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
48	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
49	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
50	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
51	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
52	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
53	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
54	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
55	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
56	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
57	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
58	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
59	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

	性公告		
60	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
61	关于鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、赎回和定期定额投资业务的公告	《证券时报》	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) 《鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金 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 43 层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

### 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

