

鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资 基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 31 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。本中期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 2020 年 08 月 28 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 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
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	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	13
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44

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	44
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	44
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	44
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	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息.....	49
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	51
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	51
§ 9 开放式基金份额变动.....	51
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
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	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金		
基金简称	鹏华证券分级		
场内简称	券商指基		
基金主代码	160633		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 5 月 6 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	789,588,158.40 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	2015 年 5 月 12 日		
下属分级基金的基金简称	鹏华证券分级	鹏华证券分级 A	鹏华证券分级 B
下属分级基金的场内简称	券商指基	券商 A 级	券商 B 级
下属分级基金的交易代码	160633	150235	150236
报告期末下属分级基金的份额总额	727,485,872.40 份	31,051,143.00 份	31,051,143.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来

	影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。 本基金力争鹏华证券份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。		
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	鹏华证券 A 份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征。		
	鹏华证券分级	鹏华证券分级 A	鹏华证券分级 B
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。	鹏华证券 A 份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征。	鹏华证券 B 份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。

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	李申
	联系电话	0755-82825720	021-60637102
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	021-60637111
传真		0755-82021126	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn

基金中期报告备置地点	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(2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	31,445,627.74
本期利润	-4,478,996.69
加权平均基金份额本期利润	-0.0057
本期加权平均净值利润率	-0.59%
本期基金份额净值增长率	-0.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,170,989,911.38
期末可供分配基金份额利润	-1.4830
期末基金资产净值	802,261,744.75
期末基金份额净值	1.016
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-39.47%

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

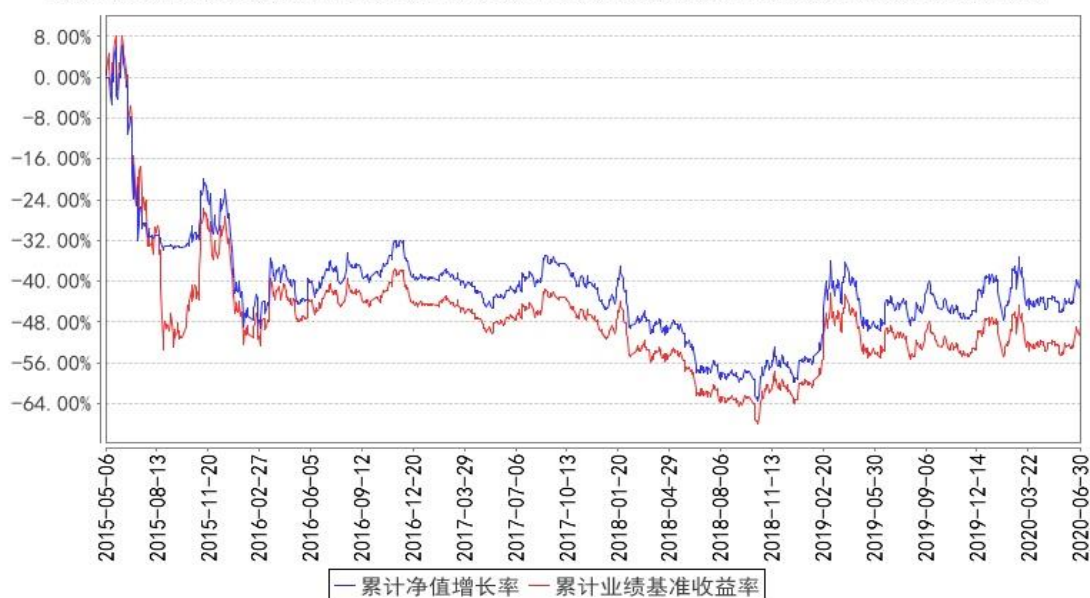
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	11.65%	1.71%	11.18%	1.72%	0.47%	-0.01%
过去三个月	9.84%	1.40%	8.89%	1.40%	0.95%	0.00%
过去六个月	-0.20%	2.06%	-2.53%	2.09%	2.33%	-0.03%
过去一年	8.43%	1.75%	1.59%	1.78%	6.84%	-0.03%
过去三年	3.58%	1.86%	-3.79%	1.88%	7.37%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-39.47%	1.96%	-48.99%	2.21%	9.52%	-0.25%

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

鹏华证券分级累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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，注册资本 15,000 万元人民币。截至 2020 年 6 月，公司管理资产总规模达到 7,014.31 亿元，管理 196 只公募基金、12 只全国社保投资组合、4 只基本养老保险投资组合。经过 22 年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
陈龙	本基金基金经理	2019-03-19	-	11 年	陈龙先生，国籍中国，经济学硕士，11 年证券基金从业经验。曾任杭州衡泰软件公司金融工程师，2009 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部金融工程总监助理、量化及衍生品投资部量化研究总监助理，先后从事金融工程、量化研究等工作，现任量化及衍生品投资部副总经理、基金经理。2015 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华钢铁分级基金基金经理，2016 年 07 月至 2018 年 04 月担任鹏华创业板分级基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 04 月担任鹏华地产分级基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华香港中小企业指数（LOF）基金基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 04 月担任鹏华互联网分级基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华国防分级基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华证券分级基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华航天军工指数（LOF）基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华证券保险分级基金基金经理，2019 年 11 月担任中证 500 基金基金经理，2019 年 12 月担任龙头券商基金基金经理，2020 年 01 月担任鹏华中证 500ETF 联接基金基金经理。陈龙先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

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

报告期内，上证指数下跌 2.15%，深证成指上涨 14.97%，本基金跟踪的中证全指证券公司指数下跌 2.81%。

报告期末，本基金份额净值为 1.0160 元，累计净值 0.6010 元。本报告期基金份额净值增长率为 -0.20%，同期业绩比较基准收益率为 -2.53%，基金年化跟踪误差为 1.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年上半年，A 股呈现极端分化的行情。沪深 300 指数上涨 1.64%，中证 500 指数上涨 11.33%，

创业板指上涨 35.60%。分行业来看，医药、科技和消费板块表现强势，金融、周期表现羸弱。

突发的疫情对上半年经济运行以及资本市场都带来的显著影响。总量上，央行为对冲疫情造成的经济冲击，总体上维持较为宽松的流动性，虽然 2 季度开始，边际上有所收紧；结构上，将行业分为疫情受益行业和受损行业，医药、科技等疫情受益行业获得资金的追捧，估值不断抬升，而金融、周期行情则受疫情拖累较为严重，估值处于历史地位。此外，2019 年以来，主动偏股型基金整体业绩表现良好，形成较好的赚钱效应，吸引居民资金借道公募基金间接参与资本市场，也为市场带来的可观的增量资金，进一步强化了市场风格。

展望 2020 年下半年，国内疫情基本得到控制，经济有望步入弱复苏的通道。国家统计局公布的二季度经济数据显示，二季度单季度 GDP 同比增长 3.2%，较一季度的-6.8%已有显著改善，下半年大概率仍会延续复苏的态势。同时，我们也看到，目前海外的疫情仍未得到较好的控制，发达经济体的经济下行压力较大，势必也会给我们出口带来较大的影响，影响国内经济的持续复苏。政策方面，未来仍需要保持相对宽松的流动性环境，货币政策的目标将从宽货币转向宽信用，同时积极的财政政策将发挥更为重要的作用。

同时，我们也关注到近期海外局势持续紧张，在美国大选的背景下，中美对抗持续升级，给资本市场带来巨大的扰动，这种状态可能会贯穿整个下半年，甚至是更长的时间。但我们相信，出现极端冲突仍属于小概率事件，市场最终会逐步消化中美对抗带来的不确定性。而且目前国内的货币政策和财政政策仍留有较大的余地，能够较好的对冲海外事件的影响。中长期来看，国内大循环会持续受到重视，利用国内不同地区经济发展水平的差异，构建国内大循环，从而保证国内生产链和供应链的稳定性。

具体到下半年的投资机会，我们认为在目前宽信用、低增长、低通胀和强改革的背景，对股票市场是相对有利的。而且考虑到后续以注册制为代表的资本市场改革将持续推进，监管需要营造一个相对稳定、良好的市场环境。

结构上，我们认为可以关注以下几个方面：1) 消费、医药和科技仍然是中长期的主线，但考虑这些板块的整体估值处于历史高位，未来个股之间会形成分化，优质的公司可以通过业绩的增长来消化估值；2) 在经济弱复苏的趋势下，可选消费板块值得特别关注，包括保险、旅游酒店等；3) 科技方向，5G 的换机需求也是下半年相对确定的机会，可以积极关注消费电子行业的机会；4) 国防军工行业可能迎来拐点线的机会，一方面是行业自身周期性的变化，另一方面是“十四五”的储备需求带来行业至少两年左右的景气周期。

本基金将积极应对各种因素指数跟踪效果带来的冲击，本基金将积极应对各种因素指数跟踪效果带来的冲击，努力使得跟踪误差控制在基金合同规定的范围内，力争为投资者带来超越指数

收益回报。

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

根据本基金基金合同约定，在存续期内，本基金（包括鹏华券商指基份额、鹏华券商指基 A 份额、鹏华券商指基 B 份额）不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、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 托管人对本中期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：鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	51,306,565.24	54,545,636.82
结算备付金		581,244.65	1,756,027.79
存出保证金		173,356.76	132,418.76
交易性金融资产	6.4.7.2	760,263,878.23	812,825,009.89
其中：股票投资		760,263,878.23	812,825,009.89
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		—	8,899,217.04

应收利息	6.4.7.5	11,854.49	12,916.74
应收股利		-	-
应收申购款		27,286,945.12	10,367,878.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		839,623,844.49	888,539,105.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		16,133,215.28	-
应付赎回款		19,870,254.38	24,525,821.86
应付管理人报酬		653,936.47	678,154.64
应付托管费		143,866.01	149,194.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	323,350.96	380,490.43
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	237,476.64	306,733.38
负债合计		37,362,099.74	26,040,394.34
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,324,229,115.48	1,421,382,738.70
未分配利润	6.4.7.10	-521,967,370.73	-558,884,027.25
所有者权益合计		802,261,744.75	862,498,711.45
负债和所有者权益总计		839,623,844.49	888,539,105.79

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额总额 789,588,158.40 份，其中鹏华证券分级基金份额总额 727,485,872.40 份，基金份额净值 1.016 元；鹏华证券分级 A 基金份额总额 31,051,143.00 份，基金份额净值 1.030 元；鹏华证券分级 B 基金份额总额 31,051,143.00 份，基金份额净值 1.002 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年
-----	-----	------------------------------	-----------------------------------

		6 月 30 日	6 月 30 日
一、收入		1,821,553.47	159,725,540.96
1. 利息收入		197,147.86	146,522.39
其中：存款利息收入	6.4.7.11	197,147.86	146,522.39
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		35,757,320.14	44,456,141.19
其中：股票投资收益	6.4.7.12	33,673,695.04	43,748,458.97
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,083,625.10	707,682.22
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-35,924,624.43	113,016,777.02
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	1,791,709.90	2,106,100.36
减：二、费用		6,300,550.16	5,230,899.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,761,346.14	2,888,293.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	827,496.13	635,424.61
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,484,106.90	1,468,951.09
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	227,600.99	238,229.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,478,996.69	154,494,641.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,478,996.69	154,494,641.88

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,421,382,738.70	-558,884,027.25	862,498,711.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,478,996.69	-4,478,996.69
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）	-97,153,623.22	41,395,653.21	-55,757,970.01
其中：1. 基金申购款	1,910,669,248.41	-799,587,142.88	1,111,082,105.53
2. 基金赎回款	-2,007,822,871.63	840,982,796.09	-1,166,840,075.54
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,324,229,115.48	-521,967,370.73	802,261,744.75
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,027,579,313.14	-607,102,738.56	420,476,574.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	154,494,641.88	154,494,641.88
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-55,049,684.35	23,368,474.04	-31,681,210.31

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	1,869,746,013.58	-808,226,817.26	1,061,519,196.32
2. 基金赎回款	-1,924,795,697.93	831,595,291.30	-1,093,200,406.63
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)	972,529,628.79	-429,239,622.64	543,290,006.15

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

鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金(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]第 505 号《关于准予鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金注册的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证全指证券公司指数分级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基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,030,703,657.95 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(2015)第 428 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,030,790,724.11 份基金份额,其中认购资金利息折合 87,066.16 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》并报中国证监会备案,本基金的基金份额包括鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“鹏华证券份额”)、鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金之 A 份额(以下简称“鹏华证券 A 份额”)、鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金之 B 份额(以下简称“鹏华证券 B 份额”)。根据对

基金财产及收益分配的不同安排，本基金的基金份额具有不同的风险收益特征。鹏华证券份额为可以申购、赎回但不能上市交易的基金份额，具有与标的指数相似的风险收益特征。鹏华证券 A 份额与鹏华证券 B 份额为可以上市交易但不能申购、赎回的基金份额，其中鹏华证券 A 份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的风险收益特征，鹏华证券 B 份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的风险收益特征。鹏华证券 A 份额与鹏华证券 B 份额的配比始终保持 1:1 的比率不变。本基金的基金份额初始公开发售结束后，场外认购的全部份额将确认为鹏华证券份额；场内认购的份额将按照 1:1 的比例确认为鹏华证券 A 份额与鹏华证券 B 份额。本基金基金合同生效后，鹏华证券份额与鹏华证券 A 份额、鹏华证券 B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。基金份额的分拆，指基金份额持有人将其持有的鹏华证券份额按照 2 份场内鹏华证券份额对应 1 份鹏华证券 A 份额与 1 份鹏华证券 B 份额的比例进行转换的行为；基金份额的合并，指基金份额持有人将其持有的鹏华证券 A 份额与鹏华证券 B 份额按照 1 份鹏华证券 A 份额与 1 份鹏华证券 B 份额对应 2 份场内鹏华证券份额的比例进行转换的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：鹏华证券份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为鹏华证券份额、鹏华证券 A 份额、鹏华证券 B 份额的份额数之和。鹏华证券 A 份额的基金份额净值为鹏华证券 A 份额的本金及约定应得收益之和。每 2 份鹏华证券份额所对应的基金资产净值等于 1 份鹏华证券 A 份额与 1 份鹏华证券 B 份额所对应的基金资产净值之和。

本基金定期进行份额折算。在鹏华证券 A 份额、鹏华证券份额存续期内的每个会计年度 11 月第一个工作日，本基金将进行基金的定期份额折算。在基金份额折算前与折算后，鹏华证券 A 份额与鹏华证券 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于鹏华证券 A 份额的约定应得收益，即鹏华证券 A 份额每个会计年度 10 月 31 日基金份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内鹏华证券份额分配给鹏华证券 A 份额持有人。鹏华证券份额持有人持有的每 2 份鹏华证券份额将按 1 份鹏华证券 A 份额获得新增鹏华证券份额的分配。持有场外鹏华证券份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外鹏华证券份额的分配；持有场内鹏华证券份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内鹏华证券份额的分配。经过上述份额折算，鹏华证券 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，鹏华证券份额的基金份额净值将相应调整。

除定期份额折算外，本基金还将在鹏华证券份额的基金份额净值达到 1.500 元时或鹏华证券 B 份额的基金份额参考净值跌至 0.250 元时进行不定期份额折算。当达到不定期折算条件时，本基金将分别对鹏华证券份额、鹏华证券 A 份额、鹏华证券 B 份额进行份额折算，份额折算后本基

金将确保鹏华证券 A 份额与鹏华证券 B 份额的比例为 1:1，份额折算后鹏华证券份额的基金份额净值、鹏华证券 A 份额与鹏华证券 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2015]第 188 号文审核同意，本基金鹏华证券 A 份额 336,303,495.00 份基金份额和鹏华证券 B 份额 336,303,496.00 份基金份额于 2015 年 5 月 15 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的鹏华证券份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为鹏华证券 A 份额和鹏华证券 B 份额即可上市流通；对于托管在场外的鹏华证券份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深交所场内后分拆为鹏华证券 A 份额和鹏华证券 B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股(含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票)、债券、股指期货、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于股票部分的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 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，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证全指证券公司指数收益率 $\times$ 95%+商业银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

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<年度报告和中期报告>》、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》、《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 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 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及 2020 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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	51,306,565.24
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	51,306,565.24

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	711,288,271.35	760,263,878.23	48,975,606.88
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	711,288,271.35	760,263,878.23	48,975,606.88

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	11,514.99
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	261.50
应收债券利息	—
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	78.00
合计	11,854.49

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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	323,350.96
银行间市场应付交易费用	—
合计	323,350.96

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	69,127.50
应付证券出借违约金	—

预提费用	118,349.14
应付指数使用费	50,000.00
合计	237,476.64

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	847,361,594.56	1,421,382,738.70
本期申购	1,139,115,298.99	1,910,669,248.41
本期赎回（以“-”号填列）	-1,196,888,735.15	-2,007,822,871.63
- 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	789,588,158.40	1,324,229,115.48

注：1、本基金的基金份额包括鹏华证券分级份额、鹏华证券分级 A 份额和鹏华证券分级 B 份额。本期申购含申购及转换入的鹏华证券分级份额和配对转入的鹏华证券分级 A 份额和鹏华证券分级 B 份额，本期赎回含赎回及转换出的鹏华证券分级份额和配对转出的鹏华证券分级 A 份额和鹏华证券分级 B 份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,293,770,961.64	734,886,934.39	-558,884,027.25
本期利润	31,445,627.74	-35,924,624.43	-4,478,996.69
本期基金份额交易产生的变动数	91,335,422.52	-49,939,769.31	41,395,653.21
其中：基金申购款	-1,705,106,979.14	905,519,836.26	-799,587,142.88
基金赎回款	1,796,442,401.66	-955,459,605.57	840,982,796.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,170,989,911.38	649,022,540.65	-521,967,370.73

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	180,269.66
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	5,895.71
其他	10,982.49
合计	197,147.86

注：其他包含认/申购款利息收入，结算保证金利息收入等。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	33,673,695.04
股票投资收益——赎回差价收入	—
股票投资收益——申购差价收入	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	33,673,695.04

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	502,163,986.44
减：卖出股票成本总额	468,490,291.40
买卖股票差价收入	33,673,695.04

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,083,625.10
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—

合计	2,083,625.10
----	--------------

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-35,924,624.43
股票投资	-35,924,624.43
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	-35,924,624.43

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,344,314.46
基金转换费收入	447,395.44
合计	1,791,709.90

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,484,106.90
银行间市场交易费用	-
合计	1,484,106.90

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	28,841.54
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	9,251.85
指数使用费	100,000.00
上市年费	29,835.26

合计	227,600.99
----	------------

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	79,460,700.94	8.49	190,276,559.24	19.63

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 2020年1月1日至2020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	72,412.72	8.60	24,450.69	7.56
关联方名称	上年度可比期间 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	173,398.28	19.73	33,894.23	6.04

注：（1）佣金的计算公式

上海/深圳证券交易所的交易佣金=股票买（卖）成交金额×佣金比率-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约定的佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。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 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,761,346.14	2,888,293.71
其中：支付销售机构的客户维护费	1,270,463.06	893,651.28

注：1、支付基金管理人鹏华基金管理公司的管理人报酬年费率为1.00%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.00%÷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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	827,496.13	635,424.61

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费年费率为 0.22%，逐日计提，按月支付。日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.22% ÷ 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	51,306,565.24	180,269.66	33,831,447.78	131,407.33

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在报告期内未参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有 1,338,560.00 股国信证券发行的 A 股普通股，成本总额为人民币 15,621,199.39 元，估值总额为人民币 15,125,728.00 元，占基金资产净值的比例为 1.89%(2019 年 6 月 30 日：本基金持有 1,107,060.00 股国信证券发行的 A 股普通股，成本总额为人民币 12,745,610.07 元，估值总额为人民币 14,568,909.60 元，占基金资产净值的比例为 2.68%)。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末(2020 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
002500	山西证券	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 10 日	配股未上市	5.00	6.54	279,960	1,399,800.00	1,830,938.40	-
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020 年 6 月	2020 年 7 月	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-

		24 日	3 日							
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 9 日	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688027	国盾量子	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 9 日	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688169	石头科技	2020 年 2 月 13 日	2020 年 8 月 21 日	锁定期股票	271.12	365.14	3,857	1,045,709.84	1,408,344.98	-
688189	南新制药	2020 年 3 月 18 日	2020 年 9 月 28 日	锁定期股票	34.94	50.21	6,833	238,745.02	343,084.93	-
688277	天智航-U	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 7 日	新股未上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688377	迪威尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688505	复旦张江	2020 年 6 月 10 日	2020 年 12 月 21 日	锁定期股票	8.95	24.78	22,688	203,057.60	562,208.64	-
688516	奥特维	2020 年 5 月 14 日	2020 年 11 月 23 日	锁定期股票	23.28	43.10	3,440	80,083.20	148,264.00	-
688528	秦川物联	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 1 日	新股未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688555	泽达易盛	2020 年 6 月 12 日	2020 年 12 月 23 日	锁定期股票	19.49	56.80	3,004	58,547.96	170,627.20	-
688568	中科星图	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688599	天合光能	2020 年 6 月 2 日	2020 年 12 月 10 日	锁定期股票	8.16	13.91	83,830	684,052.80	1,166,075.30	-

688600	皖仪科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 3 日	新股未 上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
--------	------	-----------------------	----------------------	-----------	-------	-------	-------	-----------	-----------	---

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，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 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2019 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均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，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。

于 2020 年 6 月 30 日，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。

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 2020 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	51,306,565.24	-	-	-	51,306,565.24
结算备付金	581,244.65	-	-	-	581,244.65
存出保证金	173,356.76	-	-	-	173,356.76
交易性金融资产	-	-	-	760,263,878.23	760,263,878.23
应收利息	-	-	-	11,854.49	11,854.49
应收申购款	-	-	-	27,286,945.12	27,286,945.12
资产总计	52,061,166.65	-	-	787,562,677.84	839,623,844.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	19,870,254.38	19,870,254.38
应付管理人报酬	-	-	-	653,936.47	653,936.47
应付托管费	-	-	-	143,866.01	143,866.01
应付证券清算款	-	-	-	16,133,215.28	16,133,215.28
应付交易费用	-	-	-	323,350.96	323,350.96
其他负债	-	-	-	237,476.64	237,476.64
负债总计	-	-	-	37,362,099.74	37,362,099.74
利率敏感度缺口	52,061,166.65	-	-	750,200,578.10	802,261,744.75
上年度末 2019 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	54,545,636.82	-	-	-	54,545,636.82
结算备付金	1,756,027.79	-	-	-	1,756,027.79
存出保证金	132,418.76	-	-	-	132,418.76
交易性金融资产	-	-	-	812,825,009.89	812,825,009.89
应收利息	-	-	-	12,916.74	12,916.74
应收申购款	-	-	-	10,367,878.75	10,367,878.75
应收证券清算款	-	-	-	8,899,217.04	8,899,217.04
资产总计	56,434,083.37	-	-	832,105,022.42	888,539,105.79
负债					
应付赎回款	-	-	-	24,525,821.86	24,525,821.86
应付管理人报酬	-	-	-	678,154.64	678,154.64
应付托管费	-	-	-	149,194.03	149,194.03
应付交易费用	-	-	-	380,490.43	380,490.43
其他负债	-	-	-	306,733.38	306,733.38
负债总计	-	-	-	26,040,394.34	26,040,394.34
利率敏感度缺口	56,434,083.37	-	-	806,064,628.08	862,498,711.45

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 2020 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%。

（2019 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（2019 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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。

本基金投资于股票部分的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。

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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	760,263,878.23	94.77	812,825,009.89	94.24
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	760,263,878.23	94.77	812,825,009.89	94.24

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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	37,292,510.55	40,453,104.70
	业绩比较基准下降 5%	-37,292,510.55	-40,453,104.70

注：无。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

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	760,263,878.23	90.55
	其中：股票	760,263,878.23	90.55
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	51,887,809.89	6.18
8	其他各项资产	27,472,156.37	3.27
9	合计	839,623,844.49	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	—	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	755,529,062.04	94.17

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	755,529,062.04	94.17

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	-	-
C	制造业	4,360,690.90	0.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
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	361,358.97	0.05
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	-	-
S	综合	-	-

	合计	4,734,816.19	0.59
--	----	--------------	------

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	600030	中信证券	4,534,743	109,332,653.73	13.63
2	300059	东方财富	3,508,020	70,862,004.00	8.83
3	601688	华泰证券	3,202,837	60,213,335.60	7.51
4	600837	海通证券	4,403,245	55,392,822.10	6.90
5	601211	国泰君安	2,453,868	42,353,761.68	5.28
6	600999	招商证券	1,555,962	34,153,365.90	4.26
7	000166	申万宏源	4,905,106	24,770,785.30	3.09
8	000776	广发证券	1,610,407	22,738,946.84	2.83
9	600958	东方证券	1,947,990	18,486,425.10	2.30
10	601377	兴业证券	2,550,710	17,472,363.50	2.18
11	601788	光大证券	1,062,805	17,068,648.30	2.13
12	601901	方正证券	2,239,708	15,857,132.64	1.98
13	002736	国信证券	1,338,560	15,125,728.00	1.89
14	600109	国金证券	1,316,504	15,021,310.64	1.87
15	000783	长江证券	2,106,201	14,195,794.74	1.77
16	601108	财通证券	1,367,000	14,011,750.00	1.75
17	601555	东吴证券	1,689,161	13,783,553.76	1.72
18	601990	南京证券	897,460	12,806,754.20	1.60
19	601099	太平洋	3,709,000	11,757,530.00	1.47
20	600061	国投资本	920,000	11,711,600.00	1.46
21	601162	天风证券	1,813,540	10,990,052.40	1.37
22	601066	中信建投	277,900	10,943,702.00	1.36
23	002797	第一创业	1,333,980	9,231,141.60	1.15
24	000728	国元证券	1,098,686	9,228,962.40	1.15
25	000750	国海证券	2,073,820	9,000,378.80	1.12
26	601198	东兴证券	750,288	8,178,139.20	1.02
27	601881	中国银河	701,497	8,046,170.59	1.00
28	600155	华创阳安	662,500	7,943,375.00	0.99
29	002500	山西证券	1,200,560	7,851,662.40	0.98
30	002673	西部证券	952,734	7,774,309.44	0.97
31	002926	华西证券	714,100	7,590,883.00	0.95
32	601878	浙商证券	725,500	7,189,705.00	0.90
33	600369	西南证券	1,535,822	7,049,422.98	0.88

34	600909	华安证券	985,100	6,728,233.00	0.84
35	000686	东北证券	764,075	6,456,433.75	0.80
36	002939	长城证券	506,600	6,241,312.00	0.78
37	002670	国盛金控	631,743	5,780,448.45	0.72
38	600621	华鑫股份	230,900	4,456,370.00	0.56
39	601236	红塔证券	217,400	4,217,560.00	0.53
40	601375	中原证券	727,400	3,418,780.00	0.43
41	600864	哈投股份	566,000	3,401,660.00	0.42
42	000712	锦龙股份	243,742	3,046,775.00	0.38
43	002945	华林证券	146,900	2,028,689.00	0.25
44	603093	南华期货	41,000	883,140.00	0.11
45	002961	瑞达期货	26,600	735,490.00	0.09

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	688169	石头科技	3,857	1,408,344.98	0.18
2	688599	天合光能	83,830	1,166,075.30	0.15
3	688505	复旦张江	22,688	562,208.64	0.07
4	688189	南新制药	6,833	343,084.93	0.04
5	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.02
6	688555	泽达易盛	3,004	170,627.20	0.02
7	688516	奥特维	3,440	148,264.00	0.02
8	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.02
9	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.01
10	688277	天智航-U	8,810	106,072.40	0.01
11	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.01
12	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.01
13	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.01
14	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
15	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
16	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
17	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
18	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
19	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
20	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
21	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
22	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
23	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	66,345,242.99	7.69
2	601688	华泰证券	38,396,120.42	4.45
3	600837	海通证券	33,952,211.85	3.94
4	300059	东方财富	29,034,317.19	3.37
5	601211	国泰君安	23,773,091.65	2.76
6	600999	招商证券	15,773,269.96	1.83
7	000776	广发证券	13,050,602.53	1.51
8	000166	申万宏源	12,990,523.94	1.51
9	600958	东方证券	10,871,921.47	1.26
10	601162	天风证券	10,529,967.00	1.22
11	601555	东吴证券	9,692,737.15	1.12
12	601901	方正证券	9,610,832.99	1.11
13	601377	兴业证券	9,436,672.78	1.09
14	002736	国信证券	8,820,683.15	1.02
15	601108	财通证券	8,222,468.00	0.95
16	000783	长江证券	8,050,646.00	0.93
17	601990	南京证券	7,615,771.50	0.88
18	600109	国金证券	7,342,693.00	0.85
19	601099	太平洋	7,335,825.00	0.85
20	000750	国海证券	7,177,645.00	0.83

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	600030	中信证券	72,988,210.25	8.46
2	600837	海通证券	41,148,870.74	4.77
3	300059	东方财富	34,390,863.56	3.99
4	601688	华泰证券	29,588,162.21	3.43
5	601211	国泰君安	29,166,830.73	3.38
6	600999	招商证券	19,216,577.63	2.23
7	000776	广发证券	15,820,610.84	1.83
8	000166	申万宏源	15,758,057.49	1.83
9	600958	东方证券	13,150,489.91	1.52
10	601901	方正证券	11,650,983.67	1.35
11	601377	兴业证券	11,210,631.77	1.30
12	002736	国信证券	10,774,358.67	1.25
13	601108	财通证券	9,817,484.00	1.14

14	000783	长江证券	9,671,563.21	1.12
15	601788	光大证券	8,748,844.00	1.01
16	600109	国金证券	8,746,048.00	1.01
17	601099	太平洋	8,635,252.81	1.00
18	601555	东吴证券	8,330,549.71	0.97
19	600061	国投资本	8,199,851.23	0.95
20	601990	南京证券	8,145,004.94	0.94

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	451,853,784.17
卖出股票收入（成交）总额	502,163,986.44

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

广发证券

2019 年 8 月 5 日，公司收到中国证券监督管理委员会《关于对广发证券股份有限公司采取限制业务活动措施的决定》（中国证券监督管理委员会行政监管措施决定书〔2019〕31 号），指出广发控股(香港)有限公司存在风险管控缺失、合规管理存在缺陷、内部管控不足及未做好广发控股香港月度数据统计工作等，对公司采取限制增加场外衍生品业务规模 6 个月、限制增加新业务种类 6 个月的行政监管措施。

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

招商证券

2019 年 9 月 11 日，中国证监会北京监管局向公司北京朝外大街证券营业部下发了《关于对招商证券股份有限公司北京朝外大街证券营业部采取责令改正并增加合规检查次数措施的决定》，认为该营业部在为某客户开立融资融券账户时，由于员工操作失误，该营业部将融资融券账户错误关联到另一客户股东账户下；在代销产品过程中，该营业部向某客户进行风险提示的留痕缺失。因此，北京证监局对该营业部作出责令改正并增加合规检查次数的监督管理措施决定。公司收到上述决定书后，高度重视，将严格按照监管要求进行整改并提交整改报告，并将按照监管要求对该营业部内部控制和合规风控管理开展合规检查。公司将持续采取优化系统流程、加强培训等措施，防止此类问题的再次发生。

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

华泰证券

关于华泰证券 2020 年 2 月 10 日处罚：未按规定履行客户识别义务；未按规定报送可疑交易报告；与不明的客户进行交易，中国人民银行对公司做出 1010 万元的处罚。

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

国泰君安

本基金持有的前十大证券之一的国泰君安证券股份有限公司在本报告期内有如下情形需要公告：

吉林证监局关于对国泰君安证券股份有限公司四平中央西路证券营业部采取责令改正行政监管措施的决定（20190920），具体如下：营业部员工王珏在替客户办理证券交易操作，与客户约定分享投资收益的行为，营业部未能有效防范员工违法违规风险，存在异常交易监控不到位，部分重要空白合同文本管理不到位的问题，反映公司营业部内控不完善。上述行为违反了《证券经纪人管理暂行规定》第十八条及《证券公司监督管理条例》第二十七条第一款的规定，根据规定，吉林证监局对营业部采取责令整改的行政监管措施。

深圳证监局关于对国泰君安证券股份有限公司深圳红荔西路证券营业部采取出局警示函措施的决定（20200317），具体如下：营业部存在副总经理实际履行分支机构负责人职责 4 个月未向深圳证监局报备，违反了《证券公司分支机构监管规定》第十七条相关规定，因此对营业部采取出局警示函的行政监管措施，要求营业部加强综合管理，提升合规管理水平，依法稳健经营。

中国证券监督管理委员会上海监管局关于对国泰君安证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定（20191219），具体如下：公司分支机构员工存在替客户办理证券交易操作、为客户的融资活动提供便利等违规行为，公司未能有效动态监控客户交易活动，未及时报告、处置重大异常行为，在分支机构管理、异常交易和操作监控等方面存在不足。上述行为违反了《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第 133 号）第六条第三项、《证券经纪人管理暂行规定》（证监会公告[2009]2 号）第十八条、《证券公司内部控制指引》（证监机构字[2003]260 号）第三十七条的有关规定。根据《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第三十二条第一款的规定，现决定对公司采取出具警示函的行政监管措施。

关于对国泰君安证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定（20200506），具体如下：经查，你公司作为富贵鸟股份有限公司公开发行 2014 年公司债券的承销机构和受托管理人，在尽职调查和受托管理过程中未严格遵守执业规范，未能勤勉尽责地履行相关责任，违反了中国证监会《公

司债券发行与交易管理办法》（证监会令第 113 号，以下简称《管理办法》）第七条和第四十九条的规定。

根据《管理办法》第五十八条的相关规定，我局决定对你公司采取出具警示函的监督管理措施，你公司应引以为戒，在开展业务时恪守勤勉尽责义务，严格遵守职业规范和监管规则，加强业务质量控制，提升合规水平。

如果对本监督管理措施不服，可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。

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

招商证券

关于对招商证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定（20191227），具体如下：

招商证券股份有限公司：

经查，我会发现你公司存在以下问题：一是投行部门未配备专职合规人员；部分投行异地团队未配备专职合规人员；部分分支机构未配备合规人员；部分分支机构合规人员不具备 3 年以上相关工作经验。二是部分合规人员薪酬低于公司同级别平均水平。三是未见合规总监有权参加监事会的规定。四是部分重大决策、新产品和新业务未经合规总监合规审查。

上述情况违反了《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第十三条、第二十三条、第二十五条、第二十八条、《证券公司合规管理实施指引》第二十八条、第三十一条的规定。

按照《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第三十二条的规定，我会决定对你公司采取出具警示函的行政监管措施。公司经营管理层应当按照《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》的要求，切实履行合规管理职责，为合规总监、合规部门、合规人员履职提供充分的人力、物力、财力、技术支持和保障。

如果对本监督管理措施不服，可以在收到本决定书之日起 60 日内向我会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。

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

华泰证券

关于对华泰证券股份有限公司采取责令改正监督管理措施的决定（20190823），具体如下：

华泰证券股份有限公司：

经查，你公司在代销“聚潮资产-中科招商新三板 I 期 A、B 专项资管计划”过程中，存在使用未经报备的宣传推介材料的情形。该行为违反《证券公司代销金融产品管理规定》第十条的规定，反映出你公司内部控制不完善。

根据《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，我局决定对你公司采取责令改正的监督管理措施。你公司应采取切实有效措施，完善内部控制，并于收到本决定之日起 30 日内向我局提交书面整改报告。

如对本监督管理措施不服的，可以在收到本决定之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述行政监管措施不停止执行。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	173,356.76
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	11,854.49
5	应收申购款	27,286,945.12
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	27,472,156.37

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688169	石头科技	1,408,344.98	0.18	锁定期股票
2	688599	天合光能	1,166,075.30	0.15	锁定期股票
3	688505	复旦张江	562,208.64	0.07	锁定期股票
4	688189	南新制药	343,084.93	0.04	锁定期股票
5	688568	中科星图	178,634.20	0.02	新股未上市

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

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（%）
鹏华证券分级	63,683	11,423.55	364,539.64	0.05	727,121,332.76	99.95
鹏华证券分级A	236	131,572.64	24,783,945.00	79.82	6,267,198.00	20.18
鹏华证	5,434	5,714.23	1,244,220.00	4.01	29,806,923.00	95.99

券 分 级 B						
合 计	69,353	11,385.06	26,392,704.64	3.34	763,195,453.76	96.66

8.2 期末上市基金前十名持有人

鹏华证券分级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	何玄	595,785.00	4.70
2	袁建新	406,391.00	3.21
3	王瑛	379,043.00	2.99
4	武汉涌金科技投资管理 有限责任公司	199,495.00	1.57
5	陈开容	188,808.00	1.49
6	张宇英	151,617.00	1.20
7	王辉	136,806.00	1.08
8	陶冬英	124,396.00	0.98
9	丁玉玲	112,626.00	0.89
10	李修丽	107,810.00	0.85

鹏华证券分级 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国太平洋人寿保险 股份有限公司一分红- 个人分红	10,783,498.00	34.73
2	中国太平洋人寿保险 股份有限公司一传统 —普通保险产品	10,019,122.00	32.27
3	中国银河证券股份有 限公司	1,918,757.00	6.18
4	百年人寿保险股份有 限公司—万能保险产 品	1,452,930.00	4.68
5	吴捷云	883,768.00	2.85
6	李星影	699,300.00	2.25
7	刘丽梅	691,510.00	2.23
8	蔡小婉	397,600.00	1.28
9	张雪峰	379,161.00	1.22
10	北京得鑫投资管理有 限公司	360,000.00	1.16

鹏华证券分级 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
----	-------	---------	-------------

1	史巍峰	1,075,300.00	3.46
2	张琪	864,730.00	2.78
3	袁建新	580,000.00	1.87
4	浙江巴克夏投资管理 有限公司—巴克夏月 月利 1 号	538,408.00	1.73
5	秦梦春	528,000.00	1.70
6	刘艺龙	471,731.00	1.52
7	王志勇	468,981.00	1.51
8	李鲁同	440,200.00	1.42
9	方舟	398,517.00	1.28
10	柴谦益	380,000.00	1.22

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	鹏华证券分级	359,978.38	0.0495
	鹏华证券分级 A	—	—
	鹏华证券分级 B	—	—
	合计	359,978.38	0.0456

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	鹏华证券分级	鹏华证券分级 A	鹏华证券分级 B
基金合同生效日（2015 年 5 月 6 日）基金份额总额	358,183,733.11	336,303,495.00	336,303,496.00
本报告期期初基金份额总额	784,673,780.56	31,343,907.00	31,343,907.00
本报告期基金总申购份额	1,139,115,298.99	—	—

减：本报告期基金总赎回份额	1,196,888,735.15	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	585,528.00	-292,764.00	-292,764.00
本报告期期末基金份额总额	727,485,872.40	31,051,143.00	31,051,143.00

§ 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、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	

光大证券	1	131,049,466.21	14.01%	119,425.93	14.18%	—
天风证券	1	127,780,294.65	13.66%	116,447.67	13.83%	—
中信建投	2	126,698,079.78	13.54%	115,460.38	13.71%	—
方正证券	2	94,730,673.58	10.13%	86,328.16	10.25%	—
招商证券	1	88,847,810.76	9.50%	80,967.77	9.62%	—
国联证券	1	88,815,321.16	9.49%	72,056.22	8.56%	—
国信证券	2	79,460,700.94	8.49%	72,412.72	8.60%	—
兴业证券	1	59,895,910.93	6.40%	54,582.91	6.48%	—
银河证券	1	45,736,779.84	4.89%	41,680.17	4.95%	—
中航证券	2	25,695,600.48	2.75%	23,416.19	2.78%	—
华融证券	1	17,562,156.16	1.88%	14,248.22	1.69%	—
申万宏源	1	16,416,772.64	1.75%	14,960.69	1.78%	—
国金证券	1	14,963,164.56	1.60%	13,636.00	1.62%	—
长城证券	1	7,869,569.77	0.84%	7,171.84	0.85%	—
广发证券	1	7,437,203.10	0.79%	6,777.68	0.81%	—
国泰君安	2	2,338,871.00	0.25%	2,131.43	0.25%	—
长江证券	1	255,707.00	0.03%	233.12	0.03%	—
安信证券	2	—	—	—	—	—
东方财富证 券	2	—	—	—	—	—
东方证券	1	—	—	—	—	—
东海证券	1	—	—	—	—	—
东莞证券	2	—	—	—	—	—
广州证券	1	—	—	—	—	—
海通证券	2	—	—	—	—	—
华创证券	1	—	—	—	—	—
华西证券	1	—	—	—	—	—
平安证券	2	—	—	—	—	—
瑞信方正	1	—	—	—	—	—

瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

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

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

需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

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

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性

及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在网上直销渠道开展申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 01 月 02 日
2	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》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2020 年 06 月 03 日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金招募说明书的补充提示	《上海证券报》	2020 年 01 月 16 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 01 月 17 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 01 月 17 日
6	鹏华基金管理有限公司关于增加北京植信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》	2020 年 01 月 17 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 01 月 17 日
8	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	《证券时报》	2020 年 01 月 20 日
9	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	《中国证券报》	2020 年 01 月 20 日
10	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	《上海证券报》	2020 年 01 月 20 日
11	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《证券时报》	2020 年 02 月 03 日
12	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《上海证券报》	2020 年 02 月 03 日
13	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《证券日报》	2020 年 02 月 03 日
14	鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	《证券时报》	2020 年 02 月 04 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在网上直销渠道开展申购费率优	《上海证券报》	2020 年 02 月 04 日

	惠活动的公告		
16	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《证券日报》	2020 年 02 月 05 日
17	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《证券时报》	2020 年 02 月 05 日
18	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《上海证券报》	2020 年 02 月 05 日
19	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《中国证券报》	2020 年 02 月 05 日
20	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（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 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（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 02 月 27 日
22	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（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 02 月 27 日
23	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（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 02 月 27 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》	2020 年 03 月 17 日
25	鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	《证券时报》	2020 年 03 月 19 日
26	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《证券日报》	2020 年 03 月 28 日
27	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《中国证券报》	2020 年 03 月 28 日
28	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《证券时报》	2020 年 03 月 28 日
29	鹏华基金管理有限公司关于延期披露	《上海证券报》	2020 年 03 月 28 日

	旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告		
30	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》	2020 年 04 月 15 日
31	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《证券日报》	2020 年 04 月 18 日
32	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《证券时报》	2020 年 04 月 18 日
33	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《中国证券报》	2020 年 04 月 18 日
34	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 18 日
35	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《证券时报》	2020 年 04 月 22 日
36	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 22 日
37	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《证券日报》	2020 年 04 月 22 日
38	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《中国证券报》	2020 年 04 月 22 日
39	鹏华基金管理有限公司关于结束旗下基金在中信证券华南股份有限公司（原广州证券股份有限公司）申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 04 月 28 日
40	鹏华基金管理有限公司关于结束旗下基金在中信证券华南股份有限公司（原广州证券股份有限公司）申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 28 日
41	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安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》	2020 年 05 月 06 日
42	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安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》	2020 年 05 月 06 日
43	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安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》	2020 年 05 月 06 日
44	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安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》	2020 年 05 月 06 日

	公告		
45	鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金更新的招募说明书摘要	《证券时报》	2020 年 05 月 15 日
46	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联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》	2020 年 05 月 18 日
47	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联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》	2020 年 05 月 18 日
48	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联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》	2020 年 05 月 18 日
49	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联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》	2020 年 05 月 18 日
50	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在蒙商银行股份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》	2020 年 05 月 23 日
51	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在网上直销渠道开展申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 01 月 02 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20200101~20200114	181,995,388.94	116,278,964.06	298,274,353.00	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额、指数分级基金合并份额和红利再投；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额和指数分级基金拆分份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金 2020 年中期报告》（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。

12.3 查阅方式

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

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

鹏华基金管理有限公司

2020 年 8 月 31 日