

# 鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF） 2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华中证 500 指数 (LOF)
场内简称	鹏华 500
基金主代码	160616
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2010 年 2 月 5 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	238,953,463.03 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	2010 年 4 月 28 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资方式, 追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化, 力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内, 年跟踪误差控制在 4% 以内, 以实现对中国证 500 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法, 原则上按照成份股在中证 500 指数中的基准权重构建指数化投资组合, 并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时, 或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时, 或因某些特殊情况导致流动性不足时, 或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时, 基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整, 力求降低跟踪误差。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率 $\times$ 95% + 银行同业存款利率 $\times$ 5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金, 其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金, 为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	郭明

	联系电话	0755-82825720	010-66105799
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105798

## 2.4 信息披露方式

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

### § 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	7,099,976.03
本期利润	4,396,454.05
加权平均基金份额本期利润	0.0207
本期基金份额净值增长率	1.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.2960
期末基金资产净值	309,688,217.97
期末基金份额净值	1.296

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) 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

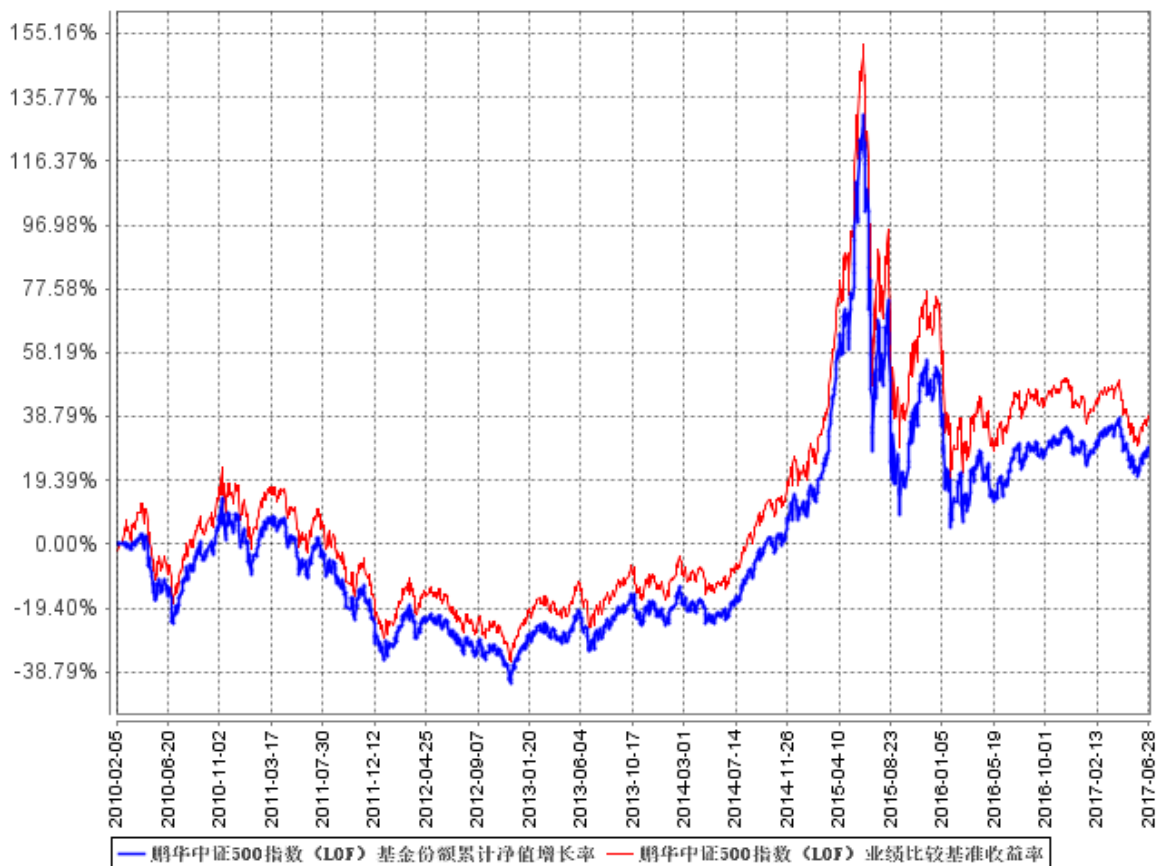
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.37%	0.89%	5.12%	0.89%	0.25%	0.00%
过去三个月	-2.85%	0.98%	-3.89%	0.97%	1.04%	0.01%
过去六个月	1.01%	0.85%	-1.86%	0.85%	2.87%	0.00%
过去一年	6.14%	0.87%	0.31%	0.86%	5.83%	0.01%
过去三年	61.19%	2.09%	54.26%	1.96%	6.93%	0.13%
自基金合同生效起至今	29.60%	1.74%	39.21%	1.68%	-9.61%	0.06%

注：本基金业绩比较基准=中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

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

鹏华中证500指数 (LOF) 基金份额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、鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同于 2010 年 2 月 5 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 2017 年 6 月, 公司管理资产总规模达到 4509.30 亿元, 管理 149 只公募基金、10 只全国社保投资组合、2 只基本养老保险投资组合。经过近 19 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		
张羽翔	本基金基金经理	2016 年 9 月 24 日	-	10	张羽翔先生, 国籍中国, 工学硕士, 10 年金融证券从业经验。曾任招商银行软件中心 (原深圳市融博技术公司) 数据分析师; 2011 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任监察稽核部资深金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员, 先后从事金融工程、量化研究等工作; 2015 年 9 月起担任鹏华上证民企 50ETF 基金及其联接基金基金经理, 2016 年 6 月起兼任鹏华新丝路分级基金基金经理, 2016 年 7 月起兼任鹏华高铁产业分级基金基金经理, 2016 年 9 月起兼任鹏华中证 500 指数 (LOF)、鹏华沪深 300 指数 (LOF) 基金基金经理, 2016 年 11 月起兼任鹏华一带一路分级、鹏华新能源分级基金基金经理。张羽翔先生具备基金从业资格。张羽翔先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金秉承指数基金的投资策略, 在应对申购赎回的基础上, 跟踪指数收益, 力争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

报告期末, 本基金份额净值为 1.296, 本报告期基金份额净值增长率为 1.01%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年上半年, 上市公司整体盈利持续向好, 主板优势明显, 上中游业绩持续提升, 周期、消费强势不改, 其中煤炭、航运、水泥等二级行业业绩大幅提升。当前周期类板块受全球贸易和美国经济的回暖, 有望继续延续当前的经济增长活力。社会消费支出对于经济增长贡献明显, 位列“三驾马车”之首, 在资本市场上, 业绩稳定的大消费股受到资金的追捧, 尤其是上半年的家电、白酒板块, 业绩争先爆发。

中国经济现正处于在本轮库存周期、房地产周期和产能周期的末端, 被动补库存、房地产调控、产能去化会给中国经济增长和结构调整带来压力。展望 2017 年下半年, 受房地产周期下行和调控影响, 房地产投资增速将下降, 基础设施投资也会受到资金供给的影响。在出口和消费保持稳定增长的情况下, 受投资增速回调的影响, 中国经济增速将放缓, 但全年实现 6.5% 的增长目标无忧。



下半年我们继续看好大盘蓝筹股持续表现和有确定业绩的新兴成长股的反弹。中长期看市场结构将进一步分化, 缺乏内生增长支撑的高估值个股将面临估值回归, 依赖内生增长、重视股东权益的上市公司将享受市场溢价和政策红利。

#### 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验的描述

###### (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[2008]38号《关于进一步规范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、本公司现没有进行任何定价服务的签约。

#### 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 70, 734, 754. 94 元, 期末基金份额净值 1. 296 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）的管理人——鹏华基金管理有限公司在鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）未进行利润分配。

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

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）2017 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告 (未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	17,795,776.87	16,076,936.00
结算备付金	89,916.26	19,484.90
存出保证金	10,604.73	35,883.53
交易性金融资产	294,156,915.14	253,384,539.83
其中：股票投资	294,156,915.14	253,384,539.83
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	58,822.90
应收利息	3,049.11	3,205.65
应收股利	-	-
应收申购款	94,803.50	251,820.60
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	312,151,065.61	269,830,693.41
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017 年 6 月 30 日</b>	<b>2016 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	1,159,685.35	-
应付赎回款	536,611.87	120,380.87
应付管理人报酬	175,552.92	173,229.06
应付托管费	35,110.61	34,645.81
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	102,014.29	82,179.39
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	453,872.60	560,262.61
负债合计	2,462,847.64	970,697.74
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	238,953,463.03	209,606,407.20
未分配利润	70,734,754.94	59,253,588.47
所有者权益合计	309,688,217.97	268,859,995.67
负债和所有者权益总计	312,151,065.61	269,830,693.41

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.296 元，基金份额总额 238,953,463.03 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		6,154,398.77	-59,336,355.98
1.利息收入		56,578.35	75,584.13
其中：存款利息收入		56,578.35	75,475.09
债券利息收入		-	109.04
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,776,063.01	-23,573,111.71
其中：股票投资收益		7,297,689.55	-25,348,330.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	13,317.35
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,478,373.46	1,761,901.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-2,703,521.98	-35,950,950.24
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		25,279.39	112,121.84
<b>减：二、费用</b>		1,757,944.72	2,386,506.01
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	1,020,277.43	1,130,250.99
2. 托管费	6.4.8.2.2	204,055.53	226,050.20

3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		229,940.27	725,468.74
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		303,671.49	304,736.08
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		4,396,454.05	-61,722,861.99
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		4,396,454.05	-61,722,861.99

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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)	209,606,407.20	59,253,588.47	268,859,995.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	4,396,454.05	4,396,454.05
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)	29,347,055.83	7,084,712.42	36,431,768.25
其中: 1. 基金申购款	56,312,629.98	15,482,355.49	71,794,985.47
2. 基金赎回款	-26,965,574.15	-8,397,643.07	-35,363,217.22
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)	238,953,463.03	70,734,754.94	309,688,217.97
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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)	239,018,594.54	118,074,481.12	357,093,075.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-61,722,861.99	-61,722,861.99
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)	10,508,779.24	-1,264,700.18	9,244,079.06
其中: 1.基金申购款	90,564,061.57	15,685,094.90	106,249,156.47
2.基金赎回款	-80,055,282.33	-16,949,795.08	-97,005,077.41
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)	249,527,373.78	55,086,918.95	304,614,292.73

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	_____ 高鹏	_____ 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 500 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]第 1374 号《关于核准鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 募集的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,629,831,732.31 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 (2009) 第 021 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2010 年 2 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,630,723,634.12 份基金份额,其中认购资金利息折合 891,901.81 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2010]第 129 号文审核同意,本基金 583,423,342.00 份基金份额于 2010 年 4 月 28 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,中证 500 指数的成份股及其备选成份股(投资比例不低于基金资产净值的 90%),现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外,为更好的实现投资目标,本基金将少量投资于非中证 500 成份股、新股(首次发行或增发等)以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 X95%+银行同业存款利率 X5%。

#### **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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2017 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 差错更正的说明**

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 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	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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。

### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	-	-	228,724,688.99	47.11%

##### 6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	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 成交总额的 比例
国信证券	-	-	14,593.60	10.04%

##### 6.4.8.1.3 债券回购交易

注：无。

##### 6.4.8.1.4 权证交易

注：无。

##### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	213,016.07	47.61%	158,622.05	50.52%
------	------------	--------	------------	--------

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

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

(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。

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,020,277.43	1,130,250.99
其中：支付销售机构的客户维护费	271,895.17	272,789.47

注：(1) 支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为 0.75%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.75%÷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。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	204,055.53	226,050.20

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费年费率为 0.15%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

### 6.4.8.2.3 销售服务费

注：无。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间, 本基金管理人未投资、持有本基金。

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

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

### 6.4.8.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	17,795,776.87	55,530.68	15,574,785.63	70,871.25

### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间没有参与关联方承销的证券。

### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.9 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 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
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-

603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000061	农产品	2017年6月28日	重大事项	9.06	-	-	49,800	452,745.84	451,188.00	-
000099	中信海直	2017年5月4日	重大事项	11.26	-	-	30,722	420,025.82	345,929.72	-
000656	金科股份	2017年5月5日	重大事项	6.89	2017年7月5日	5.92	220,400	931,876.76	1,518,556.00	-
000693	*ST华泽	2016年3月	重大	13.90	-	-	19,205	382,557.31	266,949.50	-

		月 1 日	事项							
002013	中航机电	2017 年 5 月 12 日	重大事项	10.33	2017 年 8 月 2 日	11.36	69,565	678,219.76	718,606.45	-
002025	航天电器	2016 年 9 月 12 日	重大事项	23.69	2017 年 7 月 4 日	22.46	20,267	488,078.86	480,125.23	-
002122	天马股份	2017 年 4 月 24 日	重大事项	9.67	2017 年 7 月 24 日	11.15	34,137	244,807.14	330,104.79	-
002127	南极电商	2017 年 6 月 29 日	重大事项	12.08	2017 年 7 月 6 日	12.61	56,500	704,392.00	682,520.00	-
002128	露天煤业	2017 年 3 月 17 日	重大事项	8.17	2017 年 8 月 14 日	9.57	47,500	399,207.17	388,075.00	-
002168	深圳惠程	2017 年 1 月 23 日	重大事项	16.99	-	-	53,434	729,695.86	907,843.66	-
002358	森源电气	2017 年 5 月 12 日	重大事项	17.02	2017 年 7 月 12 日	16.68	26,212	462,052.91	446,128.24	-
002399	海普瑞	2017 年 4 月 28 日	重大事项	20.23	-	-	27,000	489,760.88	546,210.00	-
002505	大康农业	2017 年 3 月 13 日	重大事项	3.50	-	-	119,070	446,629.20	416,745.00	-
002642	荣之联	2017 年 4 月 10 日	重大事项	25.06	2017 年 7 月 7 日	22.54	18,200	508,176.21	456,092.00	-
002681	奋达科技	2017 年 6 月	重大	12.59	2017 年 7 月	12.70	27,468	443,456.89	345,822.12	-

		月 22 日	事项		月 3 日						
300088	长信科技	2016 年 9 月 12 日	重大事件	15.75	2017 年 8 月 9 日	14.50	63,700	875,101.69	1,003,275.00		-
300134	大富科技	2017 年 2 月 9 日	重大事件	23.36		-	24,830	745,457.30	580,028.80		-
300291	华录百纳	2017 年 4 月 19 日	重大事件	20.02		-	23,617	697,901.10	472,812.34		-
300612	宣亚国际	2017 年 4 月 11 日	重大事件	66.33		-	750	8,070.00	49,747.50		-
600277	亿利洁能	2017 年 3 月 6 日	重大事件	7.83		-	53,800	336,489.41	421,254.00		-
600289	亿阳信通	2017 年 5 月 10 日	重大事件	10.94	2017 年 8 月 18 日	12.03	32,107	482,756.79	351,250.58		-
600460	士兰微	2017 年 5 月 12 日	重大事件	6.07	2017 年 8 月 15 日	6.68	54,169	391,008.04	328,805.83		-
600468	百利电气	2017 年 5 月 16 日	重大事件	6.50		-	23,426	216,261.96	152,269.00		-
600545	新疆城建	2017 年 6 月 22 日	重大事件	11.96	2017 年 7 月 3 日	12.44	39,642	416,008.66	474,118.32		-
600643	爱建集团	2017 年 4 月 17 日	重大事件	14.98	2017 年 8 月 2 日	16.48	103,672	1,192,547.87	1,553,006.56		-
600655	豫园商城	2016 年 12	重大	11.32		-	63,300	829,876.52	716,556.00		-

		月 20 日	事项							
600657	信达地产	2017 年 2 月 20 日	重大事件	5.76	2017 年 8 月 10 日	6.19	49,434	258,993.60	284,739.84	-
600673	东阳光科	2016 年 11 月 15 日	重大事件	6.54	-	-	118,649	874,524.37	775,964.46	-
601001	大同煤业	2017 年 6 月 22 日	重大事件	5.25	2017 年 7 月 21 日	5.78	61,400	380,593.00	322,350.00	-
601717	郑煤机	2017 年 4 月 24 日	重大事件	7.79	-	-	54,605	354,107.97	425,372.95	-

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

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	294,156,915.14	94.24
	其中：股票	294,156,915.14	94.24
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-



6	银行存款和结算备付金合计	17,885,693.13	5.73
7	其他各项资产	108,457.34	0.03
8	合计	312,151,065.61	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资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	3,708,957.70	1.20
B	采矿业	9,493,784.27	3.07
C	制造业	183,376,494.62	59.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,108,245.19	3.26
E	建筑业	6,652,001.26	2.15
F	批发和零售业	14,730,377.15	4.76
G	交通运输、仓储和邮政业	7,819,931.78	2.53
H	住宿和餐饮业	319,780.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,207,960.00	6.53
J	金融业	4,457,955.00	1.44
K	房地产业	18,041,498.07	5.83
L	租赁和商务服务业	5,573,541.74	1.80
M	科学研究和技术服务业	715,759.57	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	2,555,545.18	0.83
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	349,587.00	0.11
Q	卫生和社会工作	755,669.20	0.24
R	文化、体育和娱乐业	3,410,437.21	1.10
S	综合	1,356,479.55	0.44
	合计	293,634,004.49	94.82

### 7.2.2 期末积极投资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	采掘业	-	-
C	制造业	327,327.54	0.11
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	7,639.62	0.00
J	金融业	187,943.49	0.06
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	522,910.65	0.17

### 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前十名股票投资明细

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	占基金资产净值比例 (%)
1	300136	信维通信	57,700	2,309,154.00	0.75
2	002460	赣锋锂业	38,700	1,789,875.00	0.58
3	600487	亨通光电	63,772	1,788,804.60	0.58
4	002572	索菲亚	40,700	1,668,700.00	0.54
5	600201	生物股份	45,000	1,600,650.00	0.52
6	600643	爱建集团	103,672	1,553,006.56	0.50
7	000656	金科股份	220,400	1,518,556.00	0.49
8	601012	隆基股份	87,924	1,503,500.40	0.49
9	300156	神雾环保	44,500	1,457,820.00	0.47
10	002271	东方雨虹	38,872	1,442,151.20	0.47

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网

站 <http://www.phfund.com> 的半年度报告正文。

### 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	占基金资产净值比例 (%)
1	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.06
2	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
3	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
4	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
5	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
6	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
7	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
8	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
9	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
10	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站 <http://www.phfund.com> 的半年度报告正文。

## 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	000066	长城电脑	1,757,819.65	0.65
2	600642	申能股份	1,244,525.00	0.46
3	600521	华海药业	1,066,639.38	0.40
4	000778	新兴铸管	1,044,061.00	0.39
5	603799	华友钴业	1,018,014.00	0.38
6	000039	中集集团	943,573.97	0.35
7	600839	四川长虹	940,815.00	0.35
8	300002	神州泰岳	846,131.79	0.31
9	300383	光环新网	809,909.00	0.30
10	002583	海能达	777,105.12	0.29
11	300058	蓝色光标	764,713.00	0.28

12	600687	刚泰控股	715,783.00	0.27
13	300136	信维通信	708,045.92	0.26
14	002127	南极电商	704,392.00	0.26
15	000729	燕京啤酒	696,889.00	0.26
16	002601	佰利联	688,464.00	0.26
17	600566	济川药业	669,402.31	0.25
18	300146	汤臣倍健	632,995.00	0.24
19	000732	泰禾集团	603,006.00	0.22
20	000027	深圳能源	598,943.02	0.22

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	002508	老板电器	1,490,737.25	0.55
2	600522	中天科技	1,468,383.94	0.55
3	600682	南京新百	1,220,993.00	0.45
4	600436	片仔癀	1,191,705.00	0.44
5	600521	华海药业	1,058,125.00	0.39
6	000887	中鼎股份	962,206.66	0.36
7	000066	长城电脑	787,453.00	0.29
8	000959	首钢股份	777,392.00	0.29
9	002602	世纪华通	772,230.00	0.29
10	600497	驰宏锌锗	750,941.00	0.28
11	600549	厦门钨业	644,354.00	0.24
12	002595	豪迈科技	639,644.44	0.24
13	600601	方正科技	606,855.74	0.23
14	601212	白银有色	575,395.20	0.21
15	000961	中南建设	571,247.82	0.21
16	002242	九阳股份	506,431.00	0.19
17	601881	中国银河	504,235.98	0.19
18	600067	冠城大通	493,272.42	0.18
19	600575	皖江物流	480,274.32	0.18
20	600851	海欣股份	445,564.68	0.17

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	102,449,456.17
卖出股票收入（成交）总额	66,271,248.43

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

**7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

**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：本基金本报告期末未持有权证。

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

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券之一生物股份

关于收到中国证券监督管理委员会内蒙古监管局《行政监管措施决定书》的公告，本公司及董事会全体成员保证公告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实、准确和完整承担个别及连带责任。2016 年 12 月 1 日，金宇生物技术股份有限公司（以下简称“公司”）收到中国证券监督管理委员会内蒙古监管局（以下简称“内蒙古证监局”）《关于对金宇生物技术股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2016] 7 号，以下简称“《决定书》”）。现将《决定书》主要内容公告如下：“近期，我局对你公司进行了现场检查，发现你公司存在如下问题：一、公司会计估计变更未披露。根据财税[2014]75 号文件，2015 年，公司子公司金宇保灵生物药品有限公司本期将 100 万元以下研发用固定资产折旧一次性进费用，子公司扬州优邦生物制药有限公司对生物制药专用设备采用加速折旧，两家子公司固定资产折旧方法与生物股份年报披露的固定资产折旧政策不一致（公司 2015 年年报中披露的固定资产折旧方法为年限平均法），共计影响当期固定资产折旧金额 1,557.39 万元，上述事项应属会计估计变更。公司未对上述会计估计变更事项进行披露，年报中在重要会计政策和会计估计变更中选定为不适用。违反《上市公司信息披露管理办法》第三十条规定。二、公司财务报表列报不准确。公司 2015 年年报中，将预付技术使用费 1,196 万元和外购用友 ERP 系统费用 268.27 万元在“在建工程”项目进行核算。合并现金流量表时，将销售费用中技术推广费、疫苗补偿费等现金流出 7,375.68 万元计入“购买商品接受劳务支付的现金”。上述行为与《企业会计准则第 30 号—财务报表列报》第九条不符，违反《上市公司信息披露管理办法》第二条规定。三、内幕信息知情人登记执行不到位。公司没有对分配股利、董事及三分之一以上监事发生变化的情况制作内幕信息知情人档案；2015 年进行非公开发行时未制作重大事项进程备忘录；没有对内幕信息知情人买卖本公司股票进行自查的相关记录，内幕信息知情人登记制度中也没有规定进行自查的相关条款。违反《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第六条、第十条、第十二条的规定。针对上述问题，根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条及《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》第十五条的规定，我局决定对你公司采取责令改正的行政监管措施。你公司应当在收到本决定书之日起 30 日内向我局提交书面整改报告，我局将适时组织检查验收。如果

对本监督管理措施不服的，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。”公司董事会对上述问题高度重视，将按照《决定书》要求在规定时间内提交整改报告，同时进一步规范公司治理，并根据相关规定及时履行信息披露义务。特此公告。

本基金投资的前十名证券中的其它证券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。

本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，按照成份股权重进行配置该证券，符合指数基金的管理规定。该证券的投资已严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	10,604.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,049.11
5	应收申购款	94,803.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	108,457.34

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末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**

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	600643	爱建集团	1,553,006.56	0.50	重大事项
2	000656	金科股份	1,518,556.00	0.49	重大事项

**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	002879	长缆科技	23,660.26	0.01	新股锁定

**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
13,245	18,041.03	28,373,020.58	11.87%	210,580,442.45	88.13%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例
1	冷利群	694,024.00	7.95%
2	高炜	290,000.00	3.32%
3	黄月明	277,000.00	3.17%
4	深圳市博凯保健品有限公司	200,028.00	2.29%
5	张宏旭	200,012.00	2.29%
6	施红梅	197,014.00	2.26%
7	卢翠馨	195,030.00	2.23%
8	陈吉荃	150,042.00	1.72%
9	罗丽珊	149,225.00	1.71%
10	鹿敏理	119,003.00	1.36%

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	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	51,468.40	0.02%

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的情况

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

基金合同生效日 (2010 年 2 月 5 日) 基金份额总额	2,630,723,634.12
本报告期期初基金份额总额	209,606,407.20
本报告期基金总申购份额	56,312,629.98
减:本报告期基金总赎回份额	26,965,574.15
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	238,953,463.03

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动:

报告期内,经公司董事会审议通过,公司聘任韩亚庆先生担任公司副总经理。韩亚庆先生任职日期自 2017 年 3 月 22 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的重大人事变动:

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期基金投资策略未改变。

### 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	
长江证券	1	84,329,624.09	51.73%	76,850.23	51.20%	-
银河证券	1	77,393,320.52	47.48%	72,078.23	48.02%	-
广发证券	1	1,280,726.80	0.79%	1,167.10	0.78%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	本报告期 内撤销

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。

## § 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

注：无。

鹏华基金管理有限公司

2017 年 8 月 28 日