

鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资 基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 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 03 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 3 月 27 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	424,050,348.72 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 05 月 15 日		
下属分级基金的基 金简称	券商指基	券商 A 级	券商 B 级
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	368,376,016.72 份	27,837,166.00 份	27,837,166.00 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	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。		
	券商指基	券商 A 级	券商 B 级
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	田青
	联系电话	0755-82825720	010-67595096
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	010-67595096
传真		0755-82021126	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2018 年	2017 年	2016 年
---------	--------	--------	--------

间数据和指标			
本期已实现收益	-213,495,457.16	-59,331,110.63	-1,178,545,876.22
本期利润	-170,926,808.33	-95,704,831.71	-1,147,020,156.34
加权平均基金份额本期利润	-0.2897	-0.1216	-0.8349
本期基金份额净值增长率	-25.34%	-9.65%	-16.01%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-2.3693	-1.1505	-1.1043
期末基金资产净值	420,476,574.58	712,845,176.10	687,742,335.95
期末基金份额净值	0.992	0.842	0.955

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 12 月 31 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

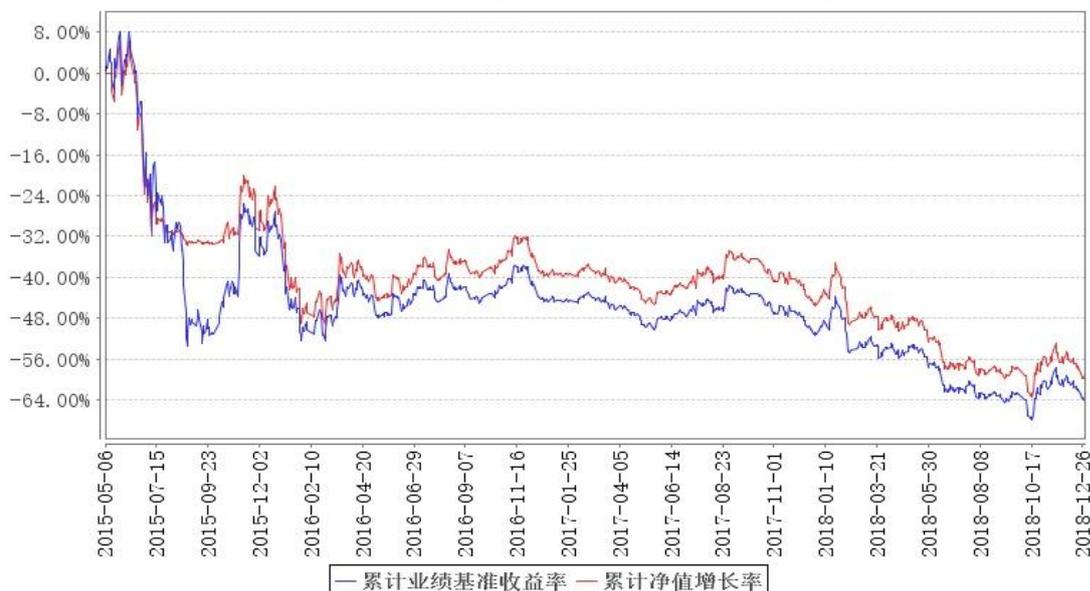
阶段	份额净值增长率① (%)	份额净值增长率标准差② (%)	业绩比较基准收益率③ (%)	业绩比较基准收益率标准差④ (%)	①-③ (%)	②-④ (%)
过去三个月	-3.31	2.37	-1.42	2.44	-1.89	-0.07
过去六个月	-5.89	1.89	-5.35	1.94	-0.54	-0.05

过去一年	-25.34	1.78	-24.91	1.81	-0.43	-0.03
过去三年	-43.34	1.70	-45.41	1.71	2.07	-0.01
自基金成立起至今	-59.08	1.91	-63.22	2.25	4.14	-0.34

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

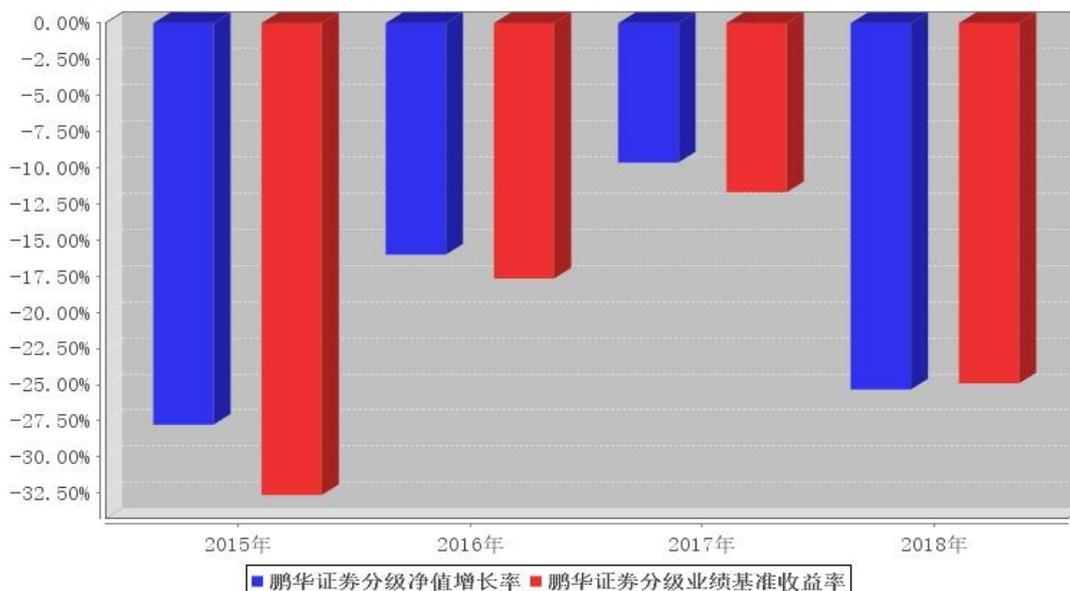


注：1、本基金基金合同于 2015 年 5 月 6 日生效。

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华证券分级基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注:1、合同生效当年按照实际存续期计算, 不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注:无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注:根据本基金基金合同约定, 在存续期内, 本基金(包括券商指基金份额、券商 A 级、券商 B 级)不进行收益分配。

§ 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。截至 2018 年 12 月, 公司管理资产总规模达到 5,164.62 亿元, 管理 146 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。经过 20 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		
余斌	本基金基金经理	2015-05-06	-	11	余斌先生，国籍中国，经济学硕士，11年证券基金从业经验。曾任职于招商证券股份有限公司，担任风险控制部市场风险分析师；2009年10月加盟鹏华基金管理有限公司，历任机构理财部大客户经理、量化投资部量化研究员，先后从事特定客户资产管理业务产品设计、量化研究等工作，现任量化投资部量化业务副总监、基金经理。2014年05月担任鹏华信息分级基金基金经理，2014年05月担任鹏华证券保险分级基金基金经理，2014年11月担任鹏华国防分级基金基金经理，2015年04月担任鹏华酒分级基金基金经理，2015年05月担任鹏华证券分级基金基金经理，2015年06月担任鹏华环保分级基金基金经理，2017年06月担任鹏华空天一体军工指数（LOF）基金基金经理，2017年06月担任鹏华量化策略混合基金基金经理，2018年04月担任鹏华地产分级基金基金经理。余斌

					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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》,将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理,在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动,建立对公平交易的执行、监督及审核流程,严禁在不同投资组合之间进行利益输送。在投资研究环节:1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”,确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用债券投资与风险控制管理规定》,执行股票及信用产品出入库及日常维护工作,确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据;3、在公司股票库基础上,各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库,基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合;4、严格执行投资授权制度,明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分,合理确定基金经理的投资权限,超过投资权限的操作,应严格履行审批程序。在交易执行环节:1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成,集中交易室负责建立和执行交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会;2、针对交易所公开竞价交易,集中交易室应严格启用恒生交易系统内的公平交易程序,交易系统则自动启用公平交易功能,由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配;如果相关基金经理坚持以不同的价格

进行交易,且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时,交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托;当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时,则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式,进行公平委托和交易量分配;3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行;银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易,各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量,公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行,对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。在交易监控、分析与评估环节:1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理,杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为,防范日常交易风险,公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制;所监控的交易包括但不限于:交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等;2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容,发现的异常情况由投资监察员进行分析;3、监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》,内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析;《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

4.3.2 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。同时,根据《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》的要求,公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析,未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.3 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

报告期内,基金运作严格按照基金合同的各项要求,依据被动化指数投资方法进行投资管理。

报告期内，基金日均跟踪偏离度和跟踪误差都有较好的控制，较好地实现了基金运作目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末，基金份额单位净值为 0.992，累计单位净值为 0.423。本报告期，基金份额净值增长率为-25.34%，基金年化跟踪误差 1.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年较为确定的因素是，影响 A 股走势的多空力量逐渐明朗，难以把握的是多空力量将以动态的形式达到平衡。在当前市场环境下，短期内多空力量可能发生逆转，局部的连续上涨或下跌均存在客观基础。

展望新的一年，对 A 股有利的因素包括：

(1) 从估值角度看，A 股已落入估值底部区域，进一步大幅下跌的可能性显著降低；

(2) A 股对配置价值正在显现。无论是 2018 年下半年以来 ETF 份额的大幅增加，还是 MSCI、富时罗素和标普道琼斯指数公司即将增加 A 股配置权重，均说明了当前机构客户从全球资产配置的角度对 A 股投资价值的认可；

(3) 美股下跌和美国经济增长拐点显现将使得中美两国的经济周期处于共振，在经济下行趋势中双方合作的诉求将多于分歧，中美贸易摩擦虽不可能完全消除，但演变程度将会大为缓和。3 月份中美贸易谈判将有可能达成积极成果。此外，美联储货币政策进一步收紧的空间依然不大，为中国进行逆周期货币调节也创造了条件；

(4) 2018 年 12 月份召开的中央经济工作会议明确了减税降费措施落地，先进制造业和先进服务业也将成为 2019 年经济下行过程中的支撑力量；

(5) 财政政策和货币政策的逆周期调节是影响资产定价的重要边际变量。

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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.9 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，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 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	22,953,917.78	42,202,369.89
结算备付金	1,669,612.52	172,917.00
存出保证金	139,103.01	219,004.40
交易性金融资产	393,872,834.46	672,393,886.75
其中：股票投资	393,872,834.46	672,393,886.75
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	3,626,142.93	-
应收利息	8,119.56	9,383.49
应收股利	-	-
应收申购款	203,001.03	361,395.31
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	422,472,731.29	715,358,956.84
负债和所有者权益	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日

负 债：		
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	-	-
应付赎回款	693,939.36	754,362.27
应付管理人报酬	391,795.90	629,537.24
应付托管费	86,195.11	138,498.18
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	422,678.37	366,996.66
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	401,547.97	624,386.39
负债合计	1,996,156.71	2,513,780.74
所有者权益：		
实收基金	1,027,579,313.14	1,300,415,469.74
未分配利润	-607,102,738.56	-587,570,293.64
所有者权益合计	420,476,574.58	712,845,176.10
负债和所有者权益总计	422,472,731.29	715,358,956.84

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额 424,050,348.72 份，其中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的份额总额为 368,376,016.72 份，份额净值 0.992 元；鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金之 A 份额的份额总额为 27,837,166.00 份，份额净值 1.018 元；鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金之 B 份额的份额总额为 27,837,166.00 份，份额净值 0.966 元。

7.2 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-161,716,231.82	-83,512,538.88
1. 利息收入		246,949.15	354,028.21
其中：存款利息收入		246,949.15	353,629.82
债券利息收入		-	398.39
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）		-205,814,153.18	-48,755,818.01
其中：股票投资收益		-213,004,805.49	-58,862,304.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	749,546.41
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		7,190,652.31	9,356,939.74
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		42,568,648.83	-36,373,721.08
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)		1,282,323.38	1,262,972.00
减：二、费用		9,210,576.51	12,192,292.83
1. 管理人报酬	7.4.7.2.1	4,981,205.47	7,332,002.83
2. 托管费	7.4.7.2.2	1,095,865.30	1,613,040.64
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		2,508,950.10	2,606,118.36
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		624,555.64	641,131.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-170,926,808.33	-95,704,831.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-170,926,808.33	-95,704,831.71

7.3 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：2018年1月1日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者	1,300,415,469.74	-587,570,293.64	712,845,176.10

权益(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-170,926,808.33	-170,926,808.33
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)	-272,836,156.60	151,394,363.41	-121,441,793.19
其中:1.基金申购款	1,611,901,254.74	-804,861,927.08	807,039,327.66
2.基金赎回款	-1,884,737,411.34	956,256,290.49	-928,481,120.85
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)	1,027,579,313.14	-607,102,738.56	420,476,574.58
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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)	1,134,052,812.72	-446,310,476.77	687,742,335.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-95,704,831.71	-95,704,831.71
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)	166,362,657.02	-45,554,985.16	120,807,671.86
其中:1.基金申购款	1,916,112,067.95	-747,259,662.75	1,168,852,405.20
2.基金赎回款	-1,749,749,410.93	701,704,677.59	-1,048,044,733.34
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)	1,300,415,469.74	-587,570,293.64	712,845,176.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>邓召明</u>	<u>苏波</u>	<u>郝文高</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：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%。

本财务报表由本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司于本基金的审计报告日批准报出。

7.4.2 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相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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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

7.4.4.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.4.3 差错更正的说明

无。

7.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税

[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

7.4.6 关联方关系

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
意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.)	基金管理人的股东
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	401,554,608.46	24.50	66,899,050.28	3.77

7.4.7.1.2 债券交易

注:无。

7.4.7.1.3 债券回购交易

注:无。

7.4.7.1.4 权证交易

注:无。

7.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31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	365,945.29	24.59	12,380.77	2.93
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	60,962.39	3.77	31,276.66	8.52

注：（1）佣金的计算公式

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

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

（2）本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。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。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,981,205.47	7,332,002.83
其中：支付销售机构的客户维护费	1,035,930.64	972,121.61

注：1、支付基金管理人鹏华基金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。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,095,865.30	1,613,040.64

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。

7.4.7.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
		当期发生的基金应支付的销售服务费
合计	-	
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
		当期发生的基金应支付的销售服务费
合计	-	

注:无。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注:本基金本年度及上年度可比报告期管理人未投资、持有本基金。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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	22,953,917.78	232,255.97	42,202,369.89	299,993.87

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位: 张)	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位: 张)	总金额
国信证券	002839	张家港行	网下申购	14,352	62,718.24
国信证券	002882	金龙羽	网下申购	2,966	18,389.20

7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

于 2018 年 12 月 31 日, 本基金持有 1,287,460 股国信证券的 A 股普通股, 成本总额为人民币 13,674,336.38 元, 估值总额为人民币 10,776,040.20 元, 占基金资产净值的比例为 2.56% (2017 年 12 月 31 日: 无)。

7.4.8 期末 (2018 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 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

7.4.8.1.1 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
601860	紫金银行	2018-12-20	2019-01-03	新股流通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-
7.4.8.1.2 受限证券类别: 债券										
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: 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
7.4.8.1.3 受限证券类别: 权证										
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: 份)	期末成本总额	期末估值总额	备注

7.4.8.2 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
600030	中信证券	2018 年 12 月	重大事项	15.87	2019 年 01 月	17.15	4,122,543	73,500,955.91	65,424,757.41	-

		月 25 日			月 10 日					
000987	越秀 金控	2018 年 12 月 25 日	重大 事项	7.97	2019 年 01 月 10 日	8.77	144,100	1,295,846.59	1,148,477.00	-

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

注:无。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 327,249,454.25 元，属于第二层次的余额为 66,623,380.21 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 672,245,378.55 元，第二层次 148,508.20 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公

允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	393,872,834.46	93.23
	其中：股票	393,872,834.46	93.23
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	24,623,530.30	5.83
8	其他各项资产	3,976,366.53	0.94
9	合计	422,472,731.29	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	393,715,964.95	93.64
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	393,715,964.95	93.64

8.2.2 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	106,723.71	0.03
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	50,145.80	0.01
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	156,869.51	0.04

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:无。

8.3 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

8.3.1 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	4,122,543	65,424,757.41	15.56
2	600837	海通证券	4,234,645	37,264,876.00	8.86
3	601211	国泰君安	2,360,002	36,155,230.64	8.60
4	601688	华泰证券	2,066,564	33,478,336.80	7.96
5	600999	招商证券	1,496,435	20,052,229.00	4.77
6	000776	广发证券	1,548,707	19,637,604.76	4.67
7	600958	东方证券	1,873,690	14,933,309.30	3.55
8	000166	申万宏源	3,538,406	14,401,312.42	3.42
9	601901	方正证券	2,153,708	11,436,189.48	2.72
10	601377	兴业证券	2,453,310	11,383,358.40	2.71

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.cn> 的年度报告正文。

8.3.2 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前五名股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.02
2	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.01
3	603629	利通电子	1,051	40,684.21	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	103,212,788.64	14.48
2	601688	华泰证券	63,041,807.24	8.84
3	600837	海通证券	62,780,215.51	8.81
4	601211	国泰君安	59,620,210.92	8.36
5	000776	广发证券	39,147,267.04	5.49
6	000166	申万宏源	37,165,989.72	5.21
7	600958	东方证券	36,044,561.18	5.06
8	600999	招商证券	32,360,185.95	4.54
9	601788	光大证券	23,064,147.93	3.24
10	601901	方正证券	22,782,373.00	3.20
11	000783	长江证券	21,720,523.81	3.05
12	601377	兴业证券	20,162,784.97	2.83
13	002736	国信证券	19,029,686.73	2.67
14	002673	西部证券	17,933,265.54	2.52
15	002500	山西证券	16,192,053.90	2.27
16	601099	太平洋	15,449,355.83	2.17
17	000728	国元证券	14,769,596.92	2.07
18	601555	东吴证券	14,617,123.81	2.05
19	601198	东兴证券	14,173,189.56	1.99
20	600109	国金证券	13,472,156.90	1.89

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。

8.4.2 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	126,477,279.87	17.74
2	600837	海通证券	77,012,253.74	10.80
3	601688	华泰证券	66,119,353.95	9.28
4	601211	国泰君安	63,955,651.91	8.97
5	000776	广发证券	45,338,348.55	6.36
6	000166	申万宏源	40,899,960.91	5.74
7	600958	东方证券	38,211,118.32	5.36
8	600999	招商证券	33,452,129.61	4.69
9	601901	方正证券	26,579,399.41	3.73
10	601099	太平洋	26,537,451.10	3.72
11	601788	光大证券	26,389,615.66	3.70
12	000783	长江证券	25,219,074.48	3.54
13	601377	兴业证券	24,488,832.90	3.44

14	002736	国信证券	22,489,454.73	3.15
15	002673	西部证券	20,718,136.58	2.91
16	002500	山西证券	19,013,593.84	2.67
17	000728	国元证券	17,485,953.18	2.45
18	601555	东吴证券	17,388,603.91	2.44
19	000750	国海证券	15,741,953.75	2.21
20	600109	国金证券	15,386,560.02	2.16
21	002797	第一创业	15,171,807.00	2.13
22	601198	东兴证券	14,561,907.34	2.04

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。

8.4.3 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	767,466,562.80
卖出股票收入(成交)总额	875,551,458.43

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注:无。

8.6 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。

8.7 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:无。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:无。

8.10.2 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,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

广发证券 本基金投资的前十大证券发行人广发证券及其子公司被证券监管部门和交易所采取处罚或监管措施情况如下：

1、2018年9月5日，广东证监局向广发合信产业投资管理有限公司（以下简称“广发合信”）出具了《关于对广发合信产业投资管理有限公司采取责令改正措施的决定》（[2018]53号），指出广发合信存在以下问题：（1）部分基金产品在募集说明书或基金合同中约定预期收益率或业绩基准收益率，并按照约定的收益率向投资者支付收益；（2）作为楚发一号私募专项投资基金的基金管理人，未采取问卷调查等方式，对投资者的风险识别能力和风险承担能力进行评估；（3）2018年3月变更合规风控负责人后，未及时向中国证券投资基金业协会报告，而对广发合信采取责令改正的行政监管措施。

整改措施：对此，根据公告，广发合信由公司高管牵头，组织全体员工对函件所反映的问题进行积极整改，措施如下：（1）修改相关基金产品《募集说明书》，删除关于预期收益率或业绩比较基准的表述，并获得所有投资者的确认；（2）与相关基金产品投资者沟通，明确上述结构化基金产品在存续期内不提高杠杆倍数、不增加净申购规模，合同到期后予以清盘，不进行续期，并积极推进提前减资工作；（3）采取问卷调查方式对相关基金投资者进行了风险识别能力和风险承担能力评估；经评估，该投资者风险承受能力为高风险，与基金的产品风险评级相匹配；（4）合规风控负责人已参加基金从业资格考试，并已取得从业资格，广发合信将尽快完成中国证券投资基金业协会平台的信息变更。

广发合信积极协调推进相关整改工作，编制整改方案，并于2018年9月28日向广东证监局报送了《广发合信产业投资管理有限公司整改情况报告》。除以上措施外，广发合信将进一步梳理

公司内部工作机制，并完善内控措施，查漏补缺，防微杜渐，确保公司未来的业务合法合规开展。

2、2018年9月5日，广东证监局向广发信德智胜投资管理有限公司（以下简称“信德智胜”）出具了《关于对广发信德智胜投资管理有限公司采取责令改正措施的决定》（[2018]54号），指出信德智胜存在以下问题：（1）部分基金产品在募集说明书或基金合同中约定预期收益率或业绩基准收益率，并按照约定的收益率向投资者支付收益；（2）作为珠海广发信德新三板股权投资基金（有限合伙）和珠海广发信德厚维投资企业（有限合伙）的基金管理人，未采取问卷调查等方式对一名投资者的风险识别能力和风险承担能力进行评估；（3）所管理的珠海横琴金投广发信德厚挚股权投资合伙企业（有限合伙）未对基金进行托管，且未在基金合同中明确保障私募财产安全的制度措施和纠纷解决机制，而对信德智胜采取责令改正的行政监管措施。

整改措施：对此，信德智胜管理层高度重视，立即组织了对相关问题的自查和整改，并形成报告及时完成向广东证监局的报备。整改方案如下：（1）资管合同中约定了预期收益率的两项资管产品，在合同中已声明该资管计划为非保本型产品，极端情况下有发生亏损的风险，预期收益率并非对投资者最低收益的保证或承诺。

已分别于2018年5月、6月完成对此两项资管产品收回本息和清算的工作。信德智胜旗下的其他资管计划严格遵守法律法规，没有出现“预期收益率”的不合规表述；（2）信德智胜立即对投资者采取调查问卷方式对其风险识别能力和风险承担能力进行评估，测试结果为其符合上述两只基金的合格投资者条件；（3）珠海横琴金投广发信德厚挚股权投资合伙企业（有限合伙）为单项目基金，只投资了一个项目，资金募集后随即全部作为投资款完成了投资，因此，该基金从业务运作上不存在对基金托管的需求，发起设立的三方自愿对该合伙企业不进行托管。截至目前，三方也未因未托管而产生任何纠纷。经自查，信德智胜目前管理的其他基金都已经托管。并且，信德智胜加快了该基金投资的项目的退出工作，之后会启动基金清算。信德智胜将严格按照法律的规定成立清算小组，进行财产分配，切实保障基金资金安全和投资人利益；（4）针对决定书提出的问题，信德智胜承诺：后续发行的任何基金产品，将会严格遵守相关法律规定，不出现任何违规表述，不出现变相承诺本金不受损失或承诺最低收益的行为，对信德智胜销售的私募基金产品均会采取问卷调查等方式对投资者的风险识别能力和风险承担能力进行评估，并由投资者书面承诺符合合格投资者条件；（5）为保护投资人的利益，信德智胜已经建立相应的内部控制指引，已经建立了完善的财产分离制度，私募基金财产与私募基金管理人固有财产之间、不同私募基金财产之间、私募基金财产和其他财产之间实行独立运作，分别核算。

综上，信德智胜将会进一步规范自身行为，进一步加强风险管理，同时信德智胜已经建立《投资者适当性管理办法》、《内部控制指引》等相关制度，将会严格遵守相关法律法规以及公司内部

制度，维护投资人的合法利益。

3、2018 年 9 月 20 日，广东证监局向瑞元资本管理有限公司（以下简称“瑞元资本”）出具了《关于对瑞元资本管理有限公司采取责令改正措施的决定》（[2018]67 号），指出瑞元资本存在以下问题：（1）公司部分专户产品自成立以来，瑞元资本作为管理人未编制并向资产委托人报送委托财产的投资报告；（2）瑞元资本璟宸股权投资专项资产管理计划为高风险产品，其中一名资产委托人的风险承受能力测评结果为稳健型，瑞元资本未就该产品风险等级超越该委托人风险承受能力的情况要求委托人确认，而对瑞元资本采取责令改正的行政监管措施。

整改措施：瑞元资本管理层对广东证监局检查发现的问题高度重视，立即组织开展全面的业务自查，积极协调推进相关整改工作，形成整改报告并于近日完成向广东证监局的报备。整改方案如下：针对投资报告问题拟定了如下整改措施：（1）加强投后管理，新设投后管理部，专门负责公司产品的投后管理和信息披露；（2）自 2018 年第四季度起，瑞元资本将按照资管合同的约定向客户提供投资报告；（3）持续加强信息披露检查力度。针对销售适当性问题拟定了如下整改措施：①建立客户风险测评和产品风险等级匹配系统；②加强客户风险承受能力的有效识别和动态管理；③完善风险匹配不一致情况下产品购买的流程管理和处理措施。除以上措施外，瑞元资本将进一步梳理公司内部工作机制，完善内控措施，查漏补缺，防微杜渐，确保公司未来的业务合法合规开展。同时要求全体人员认真总结，吸取教训，持续开展制度和业务流程的深入学习，强化风险意识、责任意识，促进瑞元资本的稳健发展。

4、2018 年 10 月 17 日，广东证监局向广发期货出具《关于对广发期货有限公司采取责令改正措施的决定》（[2018]77 号），指出广发期货资产管理业务存在第三方投顾或投资经理直接执行投资指令，未经交易员确认的问题，违反了《期货公司监督管理办法》第四十六条的规定。

整改措施：对此，广发期货高度重视，由公司高管牵头，组织资产管理部员工对相关问题进行整改，措施如下：（1）修改公司资产管理业务相关制度，明确所有资管产品的投资指令必须经过交易员确认；（2）完善资产管理业务交易系统，调整投资交易指令流程，确保资管计划的投资指令必须经过交易员确认后才能下达到柜台；（3）组织相关人员认真总结，吸取教训，持续开展监管制度和业务流程的学习，强化合规意识，确保公司资产管理业务规范运作。

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。方正证券 2018 年 3 月 26 日，方正证券收到《上海证券交易所纪律处分决定书》，具体情况如下：

方正证券股份有限公司(以下简称方正证券或公司)、公司控股股东北大方正集团有限公司(以下简称方正集团)、利德科技发展有限公司(以下简称利德科技)、西藏昭融投资有限公司(以下简称西藏昭融)、西藏容大贸易发展有限公司(以下简称西藏容大)在信息披露方面,方正集团时任董事长魏新,方正集团时任首席执行官李友,方正证券时任董事长、总经理及董事会秘书何其聪,方正集团原董事、方正证券时任董事余丽,利德科技时任董事长、方正证券时任监事郝丽敏,方正证券时任董事长雷杰和方正集团时任董事、方正证券时任董事韦俊民在职责履行方面存在以下违规行为。

一、公司控股股东方正集团和相关关联方隐瞒关联关系,方正证券未履行信息披露义务

2011年8月10日,方正证券在上海证券交易所(以下简称本所)上市。上市前,利德科技、西藏昭融、西藏容大分别持有方正证券约为3.98亿股、8,344.2万股、5,461.38万股,分别约占方正证券总股本的8.65%、1.81%、1.91%,为方正证券第二、第八、第十三大股东。根据《企业会计准则-关联方关系及其交易的披露(1997年)》和《企业会计准则第36号-关联方披露》第三条、第四条的规定,方正集团与利德科技、西藏昭融、西藏容大构成关关系,且关联关系在方正证券2011年8月上市前已形成。上述4家公司刻意隐瞒关联关系,未依法告知方正证券,致使方正证券首次公开发行股票并上市相关公告及上市后各期定期报告中,均按照招股说明书的披露口径,未依法披露上述公司的关联关系,构成信息披露虚假记载。对上述行为直接负责的主管人员为方正集团时任董事长魏新和时任首席执行官李友。

二、公司控股股东方正集团未及时告知公司签署补充协议的相关情况,方正证券未履行信息披露义务

2004年3月,方正集团改制为有限责任公司。改制完成后,北大资产经营有限公司(以下简称北大资产)持有其35%的股份,北京招润投资管理有限公司(以下简称北京招润)持有其30%的股份,成都市华鼎文化发展有限公司(以下简称成都华鼎)持有其18%的股份,深圳市康隆科技发展有限公司(以下简称深圳康隆)持有其17%的股份。经上述四家公司之间的多次股权转让后,方正集团股权结构变更为:北大资产持有方正集团70%的股份,北京招润持有方正集团30%的股份。2005年8月1日,北京大学、北大资产分别与成都华鼎、深圳康隆签署《补充协议》。根据北大资产于2015年2月提供给中国证监会的书面答复显示,成都华鼎、深圳康隆已按照上述补充协议向北大资产支付了99.993%权益转让款,各自剩余100万元尚未支付,北大资产也未将上述18%和17%的方正集团股权过户给上述两家公司。由于上述补充协议属于可能对方正证券实际控制人及控制权产生重大影响的协议或安排,方正证券应当予以披露。而方正集团未将签署补充协议的相关情况告知方正证券,未配合方正证券履行信息披露义务。方正证券在2011年8

月首次公开发行股票并上市后，未依规披露上述补充协议，构成信息披露重大遗漏。

基于上述事实 and 情节，经上海证券交易所纪律处分委员会审核通过，根据《股票上市规则》第 17.2 条、第 17.3 条、第 17.4 条及《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》的有关规定，上海证券交易所做出如下纪律处分决定：对方正证券股份有限公司，北大方正集团有限公司，利德科技发展有限公司，西藏昭融投资有限公司，西藏容大贸易发展有限公司，方正集团时任董事长魏新，方正集团时任首席执行官李友，方正证券时任董事长、总经理及董事会秘书何其聪予以公开谴责；对方正集团时任董事、方正证券时任董事余丽，利德科技时任董事长、方正证券时任监事郝丽敏，方正证券时任董事长雷杰和方正集团时任董事、方正证券时任董事韦俊民予以通报批评。对于上述纪律处分，本所将通报中国证监会和湖南省人民政府，并记入上市公司诚信档案。

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。东方证券 东方证券本次公告原因为收到此前违规情况的《行政处罚事先告知书》，具体情况说明如下。

东方证券股份有限公司（以下简称“公司”）的控股子公司东方花旗证券有限公司（以下简称“东方花旗”）于 2018 年 8 月 2 日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《调查通知书》（粤证调查通字 180138 号）。因东方花旗在担任广东广州日报传媒股份有限公司（以下简称“粤传媒”）财务顾问期间涉嫌违反证券法律法规，中国证监会决定对其立案调查，详见公司于 2018 年 8 月 3 日披露的 2018-053 号公告。

近日，东方花旗、上述项目主办人郑剑辉和蔡军强收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2018]143 号），主要内容如下：东方花旗在粤传媒收购上海香榭丽传媒股份有限公司（以下简称“香榭丽”）项目中涉嫌未勤勉尽责案，中国证监会已调查完毕，现依法拟作出行政处罚。东方花旗为粤传媒重大资产重组出具的财务顾问报告存在虚假记载。东方花旗作为粤传媒重大资产重组项目的独立财务顾问，在尽职调查过程中未勤勉尽责：未遵守尽职调查制度，未制定尽职调查清单和各主要阶段工作内容；未全面评估粤传媒并购重组活动所涉及的风险；未对上市公司并购重组活动进行充分、广泛、合理的调查，对香榭丽收入及应收账款核查程序缺失；内核机构未对应收账款问题进行核实，仅凭借项目组的回复即通过审核，内核程序流于形式。

东方花旗的上述行为违反了《财务顾问管理办法》第十九条第一项、第二十一条第一款、第二十二条第一款、第二十五条之规定，违反了《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）第一百七十三条的规定，构成《上市公司重大资产重组管理办法》（证监会令第 127 号）第五十八

条第二款、《财务顾问管理办法》第四十二条以及《证券法》第二百二十三条的情形，项目主办人郑剑辉和蔡军强是直接负责的主管人员。

根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据《证券法》第二百二十三条的规定，中国证监会拟决定：

- 一、责令东方花旗改正，没收业务收入 595 万元，并处以 1785 万元罚款；
- 二、对郑剑辉和蔡军强给予警告，并分别处以 10 万元罚款。

依据《中华人民共和国行政处罚法》第三十二条、第四十二条和《中国证券监督管理委员会行政处罚听证规则》相关规定，就中国证监会拟实施的行政处罚，东方花旗以及郑剑辉、蔡军强享有陈述、申辩及要求听证的权利。其提出的事实、理由和证据，经中国证监会复核成立的，中国证监会将予以采纳。如果放弃陈述、申辩和要求听证的权利，中国证监会将按照上述事实、理由和依据作出正式的行政处罚。

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	139,103.01
2	应收证券清算款	3,626,142.93
3	应收股利	-
4	应收利息	8,119.56
5	应收申购款	203,001.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,976,366.53

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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	600030	中信证券	65,424,757.41	15.56	重大事项

8.12.5.2 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 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601860	紫金银行	50,145.80	0.01	新股锁定

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
券商指基	15,750	23,388.95	131,749,323.02	35.76	236,626,693.70	64.24
券商A级	237	117,456.40	24,675,440.00	88.64	3,161,726.00	11.36
券商B级	6,583	4,228.64	934,355.00	3.36	26,902,811.00	96.64
合计	22,570	18,788.23	157,359,118.02	37.11	266,691,230.70	62.89

9.2 期末上市基金前十名持有人

券商指基

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	百年人寿保险股份有	5,178,900.00	54.32

	限公司—万能保险产品		
2	何玄	412,530.00	4.33
3	张素珍	412,523.00	4.33
4	王瑛	262,455.00	2.75
5	张晓峰	160,931.00	1.69
6	陈开容	125,401.00	1.32
7	张宇英	104,982.00	1.10
8	王辉	94,727.00	0.99
9	吴文萱	91,581.00	0.96
10	陈枫	80,876.00	0.85

券商 A 级

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—分红—个人分红	10,960,555.00	39.37
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	9,886,868.00	35.52
3	中国银河证券股份有限公司	2,245,459.00	8.07
4	百年人寿保险股份有限公司—万能保险产品	1,452,930.00	5.22
5	林粤舟	500,000.00	1.80
6	齐静	301,500.00	1.08
7	刘艺龙	298,700.00	1.07
8	夏永清	250,000.00	0.90
9	郭琴	232,200.00	0.83
10	李怡名	225,000.00	0.81

券商 B 级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	张琪	1,215,437.00	4.37
2	刘军	671,842.00	2.41
3	郭梓峰	652,246.00	2.34
4	袁建新	547,685.00	1.97
5	史巍峰	495,000.00	1.78
6	浙江巴克夏投资管理有限公司—巴克夏月月利 1 号	382,356.00	1.37
7	雷琰	367,370.00	1.32
8	艾炜	323,812.00	1.16
9	黄红梅	297,606.00	1.07

10	甘伟	281,700.00	1.01
----	----	------------	------

注：持有人为场内持有人。

9.3 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	券商指基	50,263.22	0.0136
	券商 A 级	-	-
	券商 B 级	-	-
	合计	50,263.22	0.0119

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。

9.4 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、基金投资和部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	券商指基	券商 A 级	券商 B 级
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	546,147,844.58	150,357,516.00	150,357,517.00
本报告期基金总申购份额	890,072,222.50	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	1,083,753,688.85	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	15,909,638.49	-122,520,350.00	-122,520,351.00
本报告期期末基金份额总额	368,376,016.72	27,837,166.00	27,837,166.00

注：

拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算中调整的份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，基金管理人无重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

无

11.5 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。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 49,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的年限为 4 年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	2	401,554,608.46	24.50%	365,945.29	24.59%	-
东方财富证券	1	206,741,206.85	12.62%	188,403.49	12.66%	-
海通证券	2	201,819,222.87	12.32%	183,914.18	12.36%	-
华创证券	1	198,077,817.05	12.09%	180,506.59	12.13%	-

天风证券	1	123,569,530.81	7.54%	112,609.85	7.57%	-
国泰君安	2	98,106,506.72	5.99%	89,404.34	6.01%	-
中金公司	2	94,673,659.78	5.78%	86,280.84	5.80%	-
方正证券	2	71,081,556.54	4.34%	64,776.55	4.35%	-
兴业证券	1	53,847,853.97	3.29%	49,070.42	3.30%	-
中信证券	1	31,957,550.31	1.95%	29,122.78	1.96%	-
长江证券	1	30,827,757.73	1.88%	28,093.05	1.89%	-
东海证券	1	27,174,124.08	1.66%	22,046.77	1.48%	-
新时代证券	1	26,727,119.04	1.63%	21,683.62	1.46%	本报告期新增
中信建投	2	22,028,969.26	1.34%	20,075.42	1.35%	-
中泰证券	2	20,513,641.85	1.25%	18,693.94	1.26%	-
国金证券	1	7,072,977.00	0.43%	6,445.75	0.43%	-
广发证券	1	6,357,567.90	0.39%	5,793.62	0.39%	-
平安证券	2	4,747,773.05	0.29%	4,326.51	0.29%	-
长城证券	1	3,815,513.49	0.23%	3,472.19	0.23%	-
上海证券	1	2,609,547.00	0.16%	2,378.01	0.16%	本报告期新增
中投证券	1	2,584,497.00	0.16%	2,355.22	0.16%	-
招商证券	1	2,047,606.00	0.12%	1,866.11	0.13%	-
光大证券	1	820,281.00	0.05%	747.50	0.05%	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	2	-	-	-	-	本报告期新增
银河证券	1	-	-	-	-	-

中航证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
申万宏源	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	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。

11.7.2 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。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20181116~20181119, 20181220~20181231	-	86,362,459.39	-	86,362,459.39	20.37
	2	20180104~20180104	153,567,861.60	-	153,567,861.60	0.00	0.00
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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

鹏华基金管理有限公司

2019年03月28日