

鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)2018 年年度报告

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 03 月 28 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 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。

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。

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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
4.10 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
§ 8 投资组合报告	47

8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
8.3 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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
8.7 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	62
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	62
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	62
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
8.12 投资组合报告附注	63
§ 9 基金份额持有人信息.....	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
9.2 期末上市基金前十名持有人	64
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	65
§ 10 开放式基金份额变动.....	65
§ 11 重大事件揭示	65
11.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
11.4 基金投资策略的改变	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.8 其他重大事件	67
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 13 备查文件目录	73
13.1 备查文件目录	73
13.2 存放地点	73
13.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)
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
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	268,637,138.23 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, 以实现中证 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
	联系电话	0755-82825720
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn
客户服务电话	4006788999	95588
传真	0755-82021126	010-66105798
注册地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	何如	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、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 期间数据和指标	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-35,415,908.79	17,658,812.21	-9,844,981.59
本期利润	-98,277,516.84	14,064,721.08	-45,987,797.64
加权平均基金份额本期利润	-0.4213	0.0674	-0.1906
本期加权平均净值利润率	-37.10%	5.08%	-15.38%
本期基金份额净值增长率	-31.64%	4.44%	-14.12%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	-22,521,094.80	81,314,302.76	59,253,588.47
期末可供分配基金	-0.0838	0.3395	0.2827

份额利润			
期末基金资产净值	246,116,043.43	320,804,630.27	268,859,995.67
期末基金份额净值	0.916	1.340	1.283
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	-8.40%	34.00%	28.30%

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 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

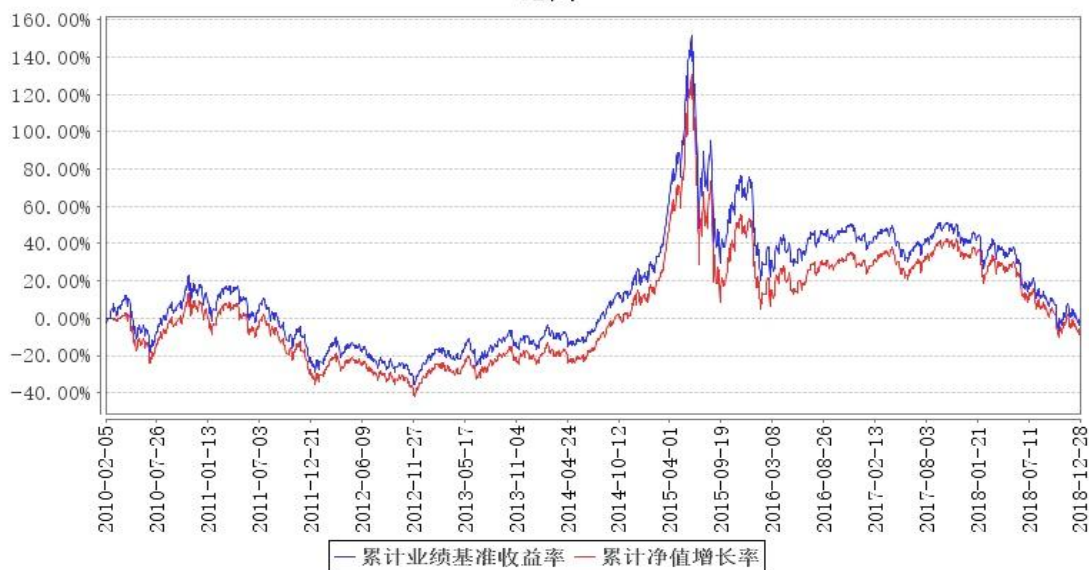
阶段	份额净值增长率① (%)	份额净值增长率标准差② (%)	业绩比较基准收益率③ (%)	业绩比较基准收益率标准差④ (%)	①-③ (%)	②-④ (%)
过去三个月	-12.93	1.74	-12.51	1.74	-0.42	0.00
过去六个月	-19.37	1.49	-19.14	1.50	-0.23	-0.01
过去一年	-31.64	1.43	-31.84	1.43	0.20	0.00
过去三年	-38.69	1.44	-43.32	1.43	4.63	0.01

过去五年	14.79	1.80	9.64	1.71	5.15	0.09
自基金成立起至今	-8.40	1.67	-3.42	1.62	-4.98	0.05

注: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

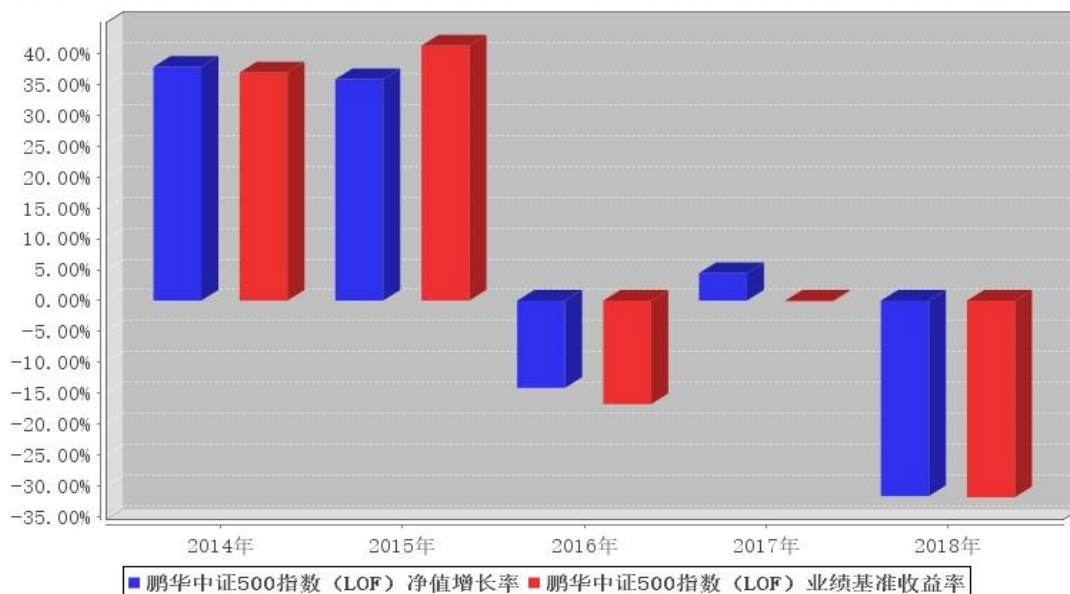
鹏华中证500指数 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注: 1、本基金基金合同于 2010 年 02 月 05 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 过去五年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

鹏华中证500指数 (LOF) 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: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: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的经验。

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	2016-09-24	-	11	<p>张羽翔先生, 国籍中国, 工学硕士, 11 年证券基金从业经验。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 09 月担任鹏华上证民企 50ETF 基金基金经理, 2015 年 09 月担任鹏华上证民企 50ETF 联接基金基金经理, 2016 年 06 月至 2018 年 05 月担任鹏华新丝路分级基金基金经理, 2016 年 07 月担任鹏华高铁分级基金基金经理, 2016 年 09 月担任鹏华沪深 300 指数 (LOF) 基金基金经理, 2016 年 09 月担任鹏华中证 500 指数 (LOF) 基金基金经理, 2016 年 11 月担任鹏华一带一路分级基金基金经理, 2016 年 11 月担任鹏华新能源分级基金基金经理, 2018 年 04 月担任鹏华创业板分级基金基金经理, 2018 年 04 月担任鹏华互联网分级基金基金经理, 2018 年 05 月至 2018 年 08 月担任鹏华沪</p>
-----	---------	------------	---	----	--

					深 300 指数增强基金基金经理, 2018 年 05 月担任鹏华香港中小企业指数 (LOF) 基金基金经理, 2018 年 05 月担任鹏华钢铁分级基金基金经理。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遵规守信情况的说明

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《证券投资基金管理公司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

本基金秉承指数基金的投资策略,在应对基金申购赎回的基础上,力争跟踪指数的收益,并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内净值增长率为-31.64%,业绩比较基准增长率-31.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年权益市场受金融去杠杆和贸易战的影响,全年指数屡创新低,成交量也低位盘整。多种风险因素积聚爆发,黑天鹅事件频出,股权质押风险,债券违约风险贯穿全年。2019 年是新中国成立 70 周年,又一个十年关口,具有承上启下的一年。2019 年国外 A 股配置需求增加,随着 MSCI 将 A 股的纳入因子提高、富时罗素和标普道琼斯将 A 股新纳入,A 股国际化利于增量资金的大规模流入,2019 年国内大规模减税降费和缓解企业融资难贵的政策陆续落地,将显著刺激内需和改善企业经营环境;将进一步增强企业的活力,提高经济抗防风险的能力,2019 年中国股市的估值优势将进一步凸显。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,基金管理人继续完善内部控制、提升风险管理水平,着重开展了以下各项工作:

1、继续完善内部控制体系

公司根据法律法规、监管要求及业务发展需求,不断优化现有的标准化业务流程体系,强调业务流程服务于加强风险防范和提升运营效率,通过信息技术手段持续提升业务操作的系统化程度,并不断优化。

2、持续改进投资监控的方法与手段,保证基金投资业务的合法合规性

报告期内,在投资日常合规监控工作方面,公司根据法律法规和产品特点进一步完善了投资监控系统以提升投资监控效率;在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上,公司加强了内幕交易风险的检查和防范,多次开展有关内幕交易的合规培训,进一步强化全体投研人员对内幕交易行为和结果的认识。

3、规范基金销售业务,保证基金销售业务的合法合规性

报告期内,在基金募集和持续营销活动中,公司严格规范基金销售业务,按照《证券投资基金销售管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料,逐步落实反洗钱法律法规各项要求,并督

促销售部门做好投资者教育工作, 本报告期内没有出现主动违规行为。

4、开展以风险为导向的内部稽核

报告期内, 监察稽核部开展了对市场营销管理、财务费用管理、反洗钱业务、子公司管理和公司日常运作的定期监察稽核与专项监察稽核。监察稽核人员开展了以风险为导向的内部稽核, 通过稽核发现, 提高了公司标准化操作流程手册的执行效力, 优化了标准化操作流程手册。报告期内, 公司未发生重大风险事件。

4.7 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。

4.8 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，本基金可供分配利润为-22,521,094.80 元，期末基金份额净值 0.916 元，不符合利润分配条件。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 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。

4.10 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) 本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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 22925 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“鹏华中证 500 指数基金 (LOF)”) 的财务报表, 包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表, 2018 年度的利润表和所有者权益 (基金净值) 变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会 (以下简称“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, 公允反映了鹏华中证 500 指数基金 (LOF) 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于鹏华中证 500 指数基金 (LOF), 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>鹏华中证 500 指数基金 (LOF) 的基金管理人鹏华基金管理有限公司 (以下简称“基金管理人”) 管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时, 基金管理人管理层负责评估鹏华中证 500 指数基金 (LOF) 的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项 (如适用), 并运用持续经营假设, 除非基金管理人管理层计划清算鹏华中证 500 指数基金 (LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督鹏华中证 500 指数基金 (LOF) 的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导

任	<p>致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对鹏华中证 500 指数基金 (LOF) 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致鹏华中证 500 指数基金 (LOF) 不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容 (包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	许康玮 陈熹
会计师事务所的地址	中国 上海市
审计报告日期	2019 年 3 月 22 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	7.4.7.1	20,971,749.69	19,409,610.76
结算备付金		233,025.93	235,763.38
存出保证金		37,173.08	62,423.95
交易性金融资产	7.4.7.2	232,590,793.15	304,203,692.35
其中：股票投资		232,590,793.15	304,203,692.35
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	4,120.08	4,285.96
应收股利		-	-
应收申购款		619,999.13	285,155.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		254,456,861.06	324,200,932.11
负债和所有者权益	附注号	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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		7,495,521.68	2,225,809.59
应付赎回款		106,861.38	88,780.44
应付管理人报酬		160,669.78	186,591.07
应付托管费		32,133.95	37,318.23
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	145,481.43	197,685.05
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	400,149.41	660,117.46
负债合计		8,340,817.63	3,396,301.84
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	268,637,138.23	239,490,327.51
未分配利润	7.4.7.10	-22,521,094.80	81,314,302.76
所有者权益合计		246,116,043.43	320,804,630.27
负债和所有者权益总计		254,456,861.06	324,200,932.11

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额 268,637,138.23 份，单位净值为 0.916 元。

7.2 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：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		-94,460,723.10	17,973,376.09
1. 利息收入		148,488.33	119,165.16
其中：存款利息收入	7.4.7.11	148,480.23	119,165.16
债券利息收入		8.10	-
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）		-31,901,065.00	21,313,653.25
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-34,606,268.02	19,230,653.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	9,572.71	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,695,630.31	2,082,999.30
3. 公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	7.4.7.17	-62,861,608.05	-3,594,091.13
4. 汇兑收益（损失以“-”号填 列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填 列）	7.4.7.18	153,461.62	134,648.81

减：二、费用		3,816,793.74	3,908,655.01
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,983,676.57	2,073,791.55
2. 托管费	7.4.10.2.2	396,735.42	414,758.37
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	825,690.73	809,427.09
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.02	-
7. 其他费用	7.4.7.20	610,691.00	610,678.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-98,277,516.84	14,064,721.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-98,277,516.84	14,064,721.08

7.3 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：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、期初所有者权益(基金净值)	239,490,327.51	81,314,302.76	320,804,630.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-98,277,516.84	-98,277,516.84
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)	29,146,810.72	-5,557,880.72	23,588,930.00
其中：1. 基金申购款	146,036,818.21	16,294,733.31	162,331,551.52
2. 基金赎回款	-116,890,007.49	-21,852,614.03	-138,742,621.52
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)	268,637,138.23	-22,521,094.80	246,116,043.43
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)	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)	-	14,064,721.08	14,064,721.08
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)	29,883,920.31	7,995,993.21	37,879,913.52
其中：1. 基金申购款	143,594,186.72	46,450,061.50	190,044,248.22
2. 基金赎回款	-113,710,266.41	-38,454,068.29	-152,164,334.70
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)	239,490,327.51	81,314,302.76	320,804,630.27

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：

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

7.4 报表附注

7.4.1 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有限公司普华永道中天验字(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%。

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 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 重要会计政策和会计估计

-

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，

申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费（如有）在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除

权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 于 2017 年 12 月 25 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 12 月 25 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，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》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

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

年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	20,971,749.69	19,409,610.76
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	20,971,749.69	19,409,610.76

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	301,071,392.06	232,590,793.15	-68,480,598.91
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		301,071,392.06	232,590,793.15	-68,480,598.91
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票		309,822,683.21	304,203,692.35	-5,618,990.86
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		309,822,683.21	304,203,692.35	-5,618,990.86

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注:无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注:无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注:无。

7.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,998.38	4,151.76
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	104.90	106.10
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-

其他	16.80	28.10
合计	4,120.08	4,285.96

7.4.7.6 其他资产

注:无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	145,481.43	197,685.05
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	145,481.43	197,685.05

7.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	149.41	117.46
预提费用	350,000.00	610,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	400,149.41	660,117.46

7.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	239,490,327.51	239,490,327.51
本期申购	146,036,818.21	146,036,818.21
本期赎回(以“-”号填列)	-116,890,007.49	-116,890,007.49
- 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	268,637,138.23	268,637,138.23

注:申购含红利再投、转换入份额。赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	207,471,911.79	-126,157,609.03	81,314,302.76
本期利润	-35,415,908.79	-62,861,608.05	-98,277,516.84
本期基金份额交易产生的变动数	20,236,947.17	-25,794,827.89	-5,557,880.72

其中：基金申购款	118,094,883.24	-101,800,149.93	16,294,733.31
基金赎回款	-97,857,936.07	76,005,322.04	-21,852,614.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	192,292,950.17	-214,814,044.97	-22,521,094.80

7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	140,374.05	115,890.14
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	4,464.10	2,662.04
其他	3,642.08	612.98
合计	148,480.23	119,165.16

7.4.7.12 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	266,365,954.21	259,650,300.31
减：卖出股票成本总额	300,972,222.23	240,419,646.36
买卖股票差价收入	-34,606,268.02	19,230,653.95

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	9,572.71	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	9,572.71	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	95,881.03	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	86,300.00	-
减：应收利息总额	8.32	-
买卖债券差价收入	9,572.71	-

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注:无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注:无。

7.4.7.16 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	2,695,630.31	2,082,999.30
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,695,630.31	2,082,999.30

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-62,861,608.05	-3,594,091.13
股票投资	-62,861,608.05	-3,594,091.13
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	-62,861,608.05	-3,594,091.13

7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	35,623.20	82,086.07

转换费收入	117,838.42	52,562.74
其他	-	-
合计	153,461.62	134,648.81

7.4.7.19 交易费用

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
交易所市场交易费用	825,690.73	809,427.09
银行间市场交易费用	-	-
合计	825,690.73	809,427.09

7.4.7.20 其他费用

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
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费用	691.00	678.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
合计	610,691.00	610,678.00

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 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
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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	274,633,194.88	49.55	228,648,554.50	41.90

7.4.10.1.2 债券交易

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	-	-	-	-

注:无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注:无。

7.4.10.1.4 权证交易

注:无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 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	253,831.64	49.76	123,016.33	84.56
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	211,156.44	42.04	158,203.66	80.03

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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	1,983,676.57	2,073,791.55
其中:支付销售机构的客户维护费	447,601.19	546,944.06

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 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。

7.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	396,735.42	414,758.37
----------------	------------	------------

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费年费率为 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。

7.4.10.2.3 销售服务费

注:无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注: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。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 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
中国工商银行	20,971,749.69	140,374.05	19,409,610.76	115,890.14

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与本管理人、管理人控股股东、托管人、委托人及委托人控股股东承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注:本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券	证券	成功	可流通	流通受限	认购	期末估	数量	期末	期末估值	备注

代码	名称	认购日	日	类型	价格	值单价	(单 位: 股)	成本总额	总额	
601860	紫金银行	2018 年 12 月 20 日	2019 年 01 月 03 日	新股流通 受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

7.4.12.1.2 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
----------	----------	-----------	----------	------------	----------	------------	-------------------	------------	------------	----

7.4.12.1.3 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
----------	----------	-----------	----------	------------	----------	------------	-------------------	------------	------------	----

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位: 人民币元

股票代 码	股票 名称	停牌日 期	停牌原 因	期末 估值单 价	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
600270	外运 发展	2018 年 12 月 13 日	终止上 市	20.99	-	-	29,222	561,183.12	613,369.78	-
002183	怡亚 通	2018 年 12 月 25 日	重大事 项	5.01	2019 年 1 月 2 日	4.96	115,900	685,842.40	580,659.00	-
000987	越秀 金控	2018 年 12 月 25 日	重大事 项	7.97	2019 年 1 月 10 日	8.77	21,500	170,731.00	171,355.00	-
000693	*ST 华 泽	2018 年 05 月 02 日	暂停上 市	0.55	-	-	19,205	382,557.31	10,562.75	-

注:根据中外运空运发展股份有限公司(以下简称“外运发展”)于 2018 年 11 月 3 日公布的《中国外运股份有限公司换股吸收合并中外运空运发展股份有限公司暨关联交易报告书》和中国外运股份有限公司(以下简称“中国外运”)于 2019 年 1 月 15 日公布的《中国外运发行 A 股股份换股吸收合并中外运空运发展股份有限公司上市公告书暨 2018 年第三季度财务报表》,中国外运向外运发展除中国外运以外的股东发行 A 股股票,以换股比例 1:3.8225 取得外运发展股东持有的中国外运全部股票,吸收合并外运发展;外运发展自 2018 年 12 月 13 日起连续停牌。换股合并后新增的中国外运股票于 2019 年 1 月 18 日上市流通,当日开盘单价为 5.24 元。外运发展自 2018 年 12 月 28 日起终止上市并摘牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注:无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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,将风险控制可在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司,与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易

均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2017 年 12 月 31 日：未持有）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 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、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注:无。

7.4.13.3.2 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、结算备付金及部分应收申购款,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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	20,971,749.69	-	-	-	20,971,749.69
结算备付金	233,025.93	-	-	-	233,025.93
存出保证金	37,173.08	-	-	-	37,173.08
交易性金融资产	-	-	-	-232,590,793.15	232,590,793.15
应收利息	-	-	-	4,120.08	4,120.08
应收申购款	-	-	-	619,999.13	619,999.13
资产总计	21,241,948.70	-	-	-233,214,912.36	254,456,861.06
负债					
应付赎回款	-	-	-	106,861.38	106,861.38
应付管理人报酬	-	-	-	160,669.78	160,669.78
应付托管费	-	-	-	32,133.95	32,133.95
应付证券清算款	-	-	-	7,495,521.68	7,495,521.68
应付交易费用	-	-	-	145,481.43	145,481.43
其他负债	-	-	-	400,149.41	400,149.41
负债总计	-	-	-	8,340,817.63	8,340,817.63
利率敏感度缺口	21,241,948.70	-	-	-224,874,094.73	246,116,043.43
上年度末 2017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	19,409,610.76	-	-	-	19,409,610.76
结算备付金	235,763.38	-	-	-	235,763.38
存出保证金	62,423.95	-	-	-	62,423.95
交易性金融资产	-	-	-	-304,203,692.35	304,203,692.35

应收利息	-	-	4,285.96	4,285.96
应收申购款	-	-	285,155.71	285,155.71
资产总计	19,707,798.09	-	304,493,134.02	324,200,932.11
负债				
应付赎回款	-	-	88,780.44	88,780.44
应付管理人报酬	-	-	186,591.07	186,591.07
应付托管费	-	-	37,318.23	37,318.23
应付证券清算款	-	-	2,225,809.59	2,225,809.59
应付交易费用	-	-	197,685.05	197,685.05
其他负债	-	-	660,117.46	660,117.46
负债总计	-	-	3,396,301.84	3,396,301.84
利率敏感度缺口	19,707,798.09	-	301,096,832.18	320,804,630.27

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%。（2017 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（2017 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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份股和备选成份股，所面临的其他价格风险来源于标的指数成份股和备选成份股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份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股，其投资比例不低于基金资产净值的 90%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定

量方法对基金进行风险度量, 包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险, 及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2018年12月31日		上年度末 2017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	232,590,793.15	94.50	304,203,692.35	94.83
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	232,590,793.15	94.50	304,203,692.35	94.83

7.4.13.4.3.2 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 (2018年12月31日)	上年度末 (2017年12月31日)	
分析	业绩比较基准上升 5%	11,641,358.17	15,951,084.04
	业绩比较基准下降 5%	-11,641,358.17	-15,951,084.04

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注: 无。

7.4.14 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 231,164,700.82 元，属于第二层次的余额为 1,415,529.58 元，属于第三层次的余额为 10,562.75 元 (2017 年 12 月 31 日：第一层次 284,380,553.88 元，第二层次 19,823,138.47 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和债券，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和债券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，确定相关股票和债券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

上述第三层次资产变动如下：

交易性金融资产

权益工具投资

2018 年 1 月 1 日 -
 购买 -
 出售 -
 转入第三层次 10,562.75
 转出第三层次 -
 当期利得或损失总额 -
 计入损益的利得或损失 -
 2018 年 12 月 31 日 10,562.75
 -276,744.05
 2018 年 12 月 31 日仍持有的资产计入
 2018 年度损益的未实现利得或损失的变动
 ——公允价值变动损益

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下:

2018 年 12 月 31 日公允价值 估值技术 不可观察输入值

名称 范围/加权平均值 与公允价值之间的关系

交易性金融资产——

股票投资 10,562.75 市场法 正相关

(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) 其他

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	232,590,793.15	91.41
	其中：股票	232,590,793.15	91.41
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	21,204,775.62	8.33
8	其他各项资产	661,292.29	0.26
9	合计	254,456,861.06	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	2,673,227.00	1.09
B	采矿业	7,662,548.85	3.11
C	制造业	130,209,642.28	52.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,496,208.09	3.05
E	建筑业	4,400,257.66	1.79
F	批发和零售业	12,146,230.61	4.94
G	交通运输、仓储和邮政业	8,249,049.81	3.35
H	住宿和餐饮业	875,922.00	0.36
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,161,136.24	8.60
J	金融业	6,937,177.64	2.82
K	房地产业	13,492,692.17	5.48
L	租赁和商务服务业	3,846,255.40	1.56
M	科学研究和技术服务业	428,736.00	0.17
N	水利、环境和公共	1,572,387.44	0.64

	设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	220,460.00	0.09
Q	卫生和社会工作	467,533.40	0.19
R	文化、体育和娱乐业	6,727,093.80	2.73
S	综合	2,271,659.25	0.92
	合计	230,838,217.64	93.79

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	844,124.71	0.34
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	150,605.00	0.06
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	757,845.80	0.31
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	1,752,575.51	0.71

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所有股票投资明细

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	600201	生物股份	93,838	1,557,710.80	0.63
2	000656	金科股份	215,300	1,332,707.00	0.54
3	600872	中炬高新	43,578	1,283,807.88	0.52
4	600256	广汇能源	321,780	1,209,892.80	0.49
5	000623	吉林敖东	83,100	1,199,133.00	0.49
6	300146	汤臣倍健	70,500	1,197,795.00	0.49
7	000998	隆平高科	78,500	1,161,800.00	0.47
8	300253	卫宁健康	88,485	1,102,523.10	0.45
9	002410	广联达	52,500	1,092,525.00	0.44
10	600642	申能股份	219,800	1,072,624.00	0.44
11	600426	华鲁恒升	88,567	1,069,003.69	0.43
12	600820	隧道股份	168,500	1,054,810.00	0.43
13	000860	顺鑫农业	31,188	994,585.32	0.40
14	002465	海格通信	126,200	984,360.00	0.40
15	300413	芒果超媒	26,500	980,765.00	0.40
16	600298	安琪酵母	38,618	974,332.14	0.40
17	002049	紫光国微	33,500	968,150.00	0.39
18	600779	水井坊	30,500	965,935.00	0.39
19	600600	青岛啤酒	27,200	948,192.00	0.39
20	600879	航天电子	175,100	947,291.00	0.38
21	002129	中环股份	130,600	944,238.00	0.38
22	600895	张江高科	63,000	941,850.00	0.38
23	000690	宝新能源	139,260	937,219.80	0.38
24	600528	中铁工业	88,100	925,050.00	0.38
25	002223	鱼跃医疗	47,005	921,768.05	0.37
26	300383	光环新网	72,200	914,774.00	0.37
27	002507	涪陵榨菜	42,300	913,680.00	0.37
28	000401	冀东水泥	73,800	913,644.00	0.37
29	300450	先导智能	31,500	911,610.00	0.37
30	002340	格林美	235,415	903,993.60	0.37
31	600804	鹏博士	127,900	899,137.00	0.37
32	002500	山西证券	151,500	896,880.00	0.36
33	600567	山鹰纸业	285,600	891,072.00	0.36
34	002470	金正大	140,700	889,224.00	0.36
35	601168	西部矿业	152,600	888,132.00	0.36
36	000060	中金岭南	223,100	883,476.00	0.36
37	002439	启明星辰	42,700	877,912.00	0.36

38	600673	东阳光科	120,049	873,956.72	0.36
39	600811	东方集团	238,740	873,788.40	0.36
40	600183	生益科技	84,300	848,058.00	0.34
41	600325	华发股份	136,675	847,385.00	0.34
42	600022	山东钢铁	530,450	832,806.50	0.34
43	002268	卫士通	46,580	831,918.80	0.34
44	600376	首开股份	115,200	828,288.00	0.34
45	002281	光迅科技	30,760	826,213.60	0.34
46	300168	万达信息	68,700	823,713.00	0.33
47	000997	新大陆	55,886	818,171.04	0.33
48	000581	威孚高科	45,800	808,828.00	0.33
49	600808	马钢股份	233,100	806,526.00	0.33
50	000778	新兴铸管	187,100	806,401.00	0.33
51	002506	协鑫集成	161,200	806,000.00	0.33
52	000975	银泰资源	79,000	805,010.00	0.33
53	002038	双鹭药业	32,100	796,401.00	0.32
54	600885	宏发股份	35,080	791,404.80	0.32
55	600718	东软集团	68,000	785,400.00	0.32
56	000830	鲁西化工	80,127	785,244.60	0.32
57	000686	东北证券	125,400	785,004.00	0.32
58	002195	二三四五	211,470	780,324.30	0.32
59	300315	掌趣科技	220,800	779,424.00	0.32
60	600643	爱建集团	91,472	776,597.28	0.32
61	000999	华润三九	30,900	768,174.00	0.31
62	600079	人福医药	74,000	750,360.00	0.30
63	000008	神州高铁	192,800	749,992.00	0.30
64	000418	小天鹅 A	17,259	746,451.75	0.30
65	600143	金发科技	148,600	735,570.00	0.30
66	002127	南极电商	97,650	734,328.00	0.30
67	002013	中航机电	112,797	734,308.47	0.30
68	000039	中集集团	69,100	731,078.00	0.30
69	002372	伟星新材	46,900	727,419.00	0.30
70	300274	阳光电源	81,540	727,336.80	0.30
71	600392	盛和资源	84,429	726,933.69	0.30
72	601872	招商轮船	197,000	726,930.00	0.30
73	000009	中国宝安	167,900	723,649.00	0.29
74	600161	天坛生物	34,015	722,818.75	0.29
75	600315	上海家化	26,213	715,614.90	0.29
76	600160	巨化股份	107,880	715,244.40	0.29
77	601098	中南传媒	57,100	713,750.00	0.29
78	600755	厦门国贸	102,213	713,446.74	0.29
79	002092	中泰化学	100,568	709,004.40	0.29

80	002074	国轩高科	60,900	704,004.00	0.29
81	300027	华谊兄弟	148,700	697,403.00	0.28
82	600008	首创股份	203,100	696,633.00	0.28
83	600875	东方电气	88,100	695,109.00	0.28
84	600021	上海电力	85,800	694,980.00	0.28
85	600655	豫园股份	93,900	694,860.00	0.28
86	002078	太阳纸业	121,528	692,709.60	0.28
87	600839	四川长虹	297,500	687,225.00	0.28
88	600967	内蒙一机	66,000	686,400.00	0.28
89	603077	和邦生物	422,980	685,227.60	0.28
90	300001	特锐德	39,000	683,670.00	0.28
91	002399	海普瑞	29,500	679,975.00	0.28
92	600166	福田汽车	371,300	675,766.00	0.27
93	002463	沪电股份	93,219	668,380.23	0.27
94	000066	中国长城	140,291	664,979.34	0.27
95	002174	游族网络	35,600	661,804.00	0.27
96	002358	森源电气	37,012	658,813.60	0.27
97	601106	中国一重	244,900	653,883.00	0.27
98	002110	三钢闽光	51,100	653,569.00	0.27
99	603899	晨光文具	21,600	653,400.00	0.27
100	000932	华菱钢铁	107,700	652,662.00	0.27
101	002373	千方科技	58,614	651,787.68	0.26
102	000681	视觉中国	27,900	650,628.00	0.26
103	000813	德展健康	70,700	649,026.00	0.26
104	600507	方大特钢	64,700	646,353.00	0.26
105	601866	中远海发	283,300	645,924.00	0.26
106	600373	中文传媒	49,300	641,393.00	0.26
107	002670	国盛金控	63,620	641,289.60	0.26
108	002221	东华能源	79,518	640,915.08	0.26
109	002299	圣农发展	38,700	640,098.00	0.26
110	600801	华新水泥	38,007	635,477.04	0.26
111	000089	深圳机场	81,400	634,106.00	0.26
112	600584	长电科技	76,441	629,873.84	0.26
113	000559	万向钱潮	122,900	629,248.00	0.26
114	600572	康恩贝	105,177	623,699.61	0.25
115	000960	锡业股份	65,200	622,008.00	0.25
116	000729	燕京啤酒	110,100	620,964.00	0.25
117	600277	亿利洁能	109,700	620,902.00	0.25
118	600270	外运发展	29,222	613,369.78	0.25
119	600388	龙净环保	60,300	612,045.00	0.25
120	600258	首旅酒店	38,200	609,672.00	0.25
121	601128	常熟银行	99,200	609,088.00	0.25

122	002385	大北农	189,400	606,080.00	0.25
123	000636	风华高科	56,000	601,440.00	0.24
124	600737	中粮糖业	81,400	599,104.00	0.24
125	300088	长信科技	143,800	596,770.00	0.24
126	000887	中鼎股份	58,900	596,068.00	0.24
127	300166	东方国信	57,419	594,860.84	0.24
128	000547	航天发展	78,200	591,192.00	0.24
129	600282	南钢股份	172,200	588,924.00	0.24
130	000488	晨鸣纸业	104,359	585,453.99	0.24
131	600138	中青旅	45,216	582,834.24	0.24
132	600266	北京城建	73,500	582,120.00	0.24
133	000598	兴蓉环境	144,400	581,932.00	0.24
134	300418	昆仑万维	45,200	581,272.00	0.24
135	002183	怡亚通	115,900	580,659.00	0.24
136	600782	新钢股份	113,900	579,751.00	0.24
137	300316	晶盛机电	57,400	575,148.00	0.23
138	002589	瑞康医药	82,310	573,700.70	0.23
139	600959	江苏有线	138,700	571,444.00	0.23
140	000988	华工科技	47,650	568,941.00	0.23
141	000930	中粮生化	76,647	568,720.74	0.23
142	601000	唐山港	238,798	568,339.24	0.23
143	603369	今世缘	39,200	568,008.00	0.23
144	600884	杉杉股份	43,946	567,782.32	0.23
145	002384	东山精密	50,234	567,141.86	0.23
146	000732	泰禾集团	40,200	563,604.00	0.23
147	600260	凯乐科技	33,159	562,708.23	0.23
148	600511	国药股份	24,192	562,464.00	0.23
149	002353	杰瑞股份	37,400	561,000.00	0.23
150	002583	海能达	70,900	559,401.00	0.23
151	000513	丽珠集团	22,239	559,310.85	0.23
152	600500	中化国际	81,400	556,776.00	0.23
153	601179	中国西电	164,300	552,048.00	0.22
154	600729	重庆百货	19,471	551,029.30	0.22
155	600291	西水股份	53,500	550,515.00	0.22
156	002191	劲嘉股份	70,124	547,668.44	0.22
157	600827	百联股份	64,500	545,025.00	0.22
158	600863	内蒙华电	234,200	541,002.00	0.22
159	600649	城投控股	98,800	540,436.00	0.22
160	002176	江特电机	92,000	540,040.00	0.22
161	000878	云南铜业	68,100	540,033.00	0.22
162	002371	北方华创	14,275	539,024.00	0.22
163	002916	深南电路	6,700	537,139.00	0.22

164	002152	广电运通	95,700	536,877.00	0.22
165	600064	南京高科	67,622	532,861.36	0.22
166	600060	海信电器	61,300	532,084.00	0.22
167	603885	吉祥航空	42,300	530,019.00	0.22
168	002155	湖南黄金	67,500	529,875.00	0.22
169	600056	中国医药	42,094	529,121.58	0.21
170	600312	平高电气	65,412	528,528.96	0.21
171	601718	际华集团	156,800	525,280.00	0.21
172	601231	环旭电子	58,300	524,700.00	0.21
173	002640	跨境通	48,400	522,720.00	0.21
174	000667	美好置业	208,591	521,477.50	0.21
175	002273	水晶光电	54,480	520,828.80	0.21
176	600435	北方导航	69,772	517,010.52	0.21
177	002266	浙富控股	126,940	516,645.80	0.21
178	600125	铁龙物流	73,563	514,941.00	0.21
179	002004	华邦健康	111,335	513,254.35	0.21
180	601966	玲珑轮胎	37,500	511,875.00	0.21
181	601958	金钼股份	86,400	511,488.00	0.21
182	600410	华胜天成	86,995	509,790.70	0.21
183	600380	健康元	76,248	508,574.16	0.21
184	300133	华策影视	56,400	505,344.00	0.21
185	002244	滨江集团	126,692	504,234.16	0.20
186	002019	亿帆医药	47,100	503,970.00	0.20
187	600418	江淮汽车	104,468	502,491.08	0.20
188	000027	深圳能源	95,700	502,425.00	0.20
189	600466	蓝光发展	93,260	501,738.80	0.20
190	600460	士兰微	61,469	499,128.28	0.20
191	002603	以岭药业	47,700	498,942.00	0.20
192	000685	中山公用	71,274	498,918.00	0.20
193	600062	华润双鹤	41,212	498,253.08	0.20
194	002051	中工国际	44,732	495,630.56	0.20
195	000970	中科三环	67,300	493,309.00	0.20
196	000717	韶钢松山	108,000	491,400.00	0.20
197	002408	齐翔腾达	71,781	490,982.04	0.20
198	600848	上海临港	23,700	490,116.00	0.20
199	000807	云铝股份	126,200	489,656.00	0.20
200	600026	中远海能	110,256	489,536.64	0.20
201	600536	中国软件	23,375	489,238.75	0.20
202	600037	歌华有线	56,700	487,053.00	0.20
203	300324	旋极信息	86,722	486,510.42	0.20
204	000596	古井贡酒	9,000	485,640.00	0.20
205	000528	柳工	79,980	485,478.60	0.20

206	002440	闰土股份	53,911	485,199.00	0.20
207	000028	国药一致	11,657	483,066.08	0.20
208	002407	多氟多	43,900	481,144.00	0.20
209	600598	北大荒	56,200	481,072.00	0.20
210	600158	中体产业	53,871	478,913.19	0.19
211	600664	哈药股份	120,960	477,792.00	0.19
212	002250	联化科技	50,649	477,620.07	0.19
213	600717	天津港	67,500	477,225.00	0.19
214	600094	大名城	129,800	473,770.00	0.19
215	002491	通鼎互联	60,100	473,588.00	0.19
216	600348	阳泉煤业	93,900	473,256.00	0.19
217	601928	凤凰传媒	59,600	473,224.00	0.19
218	600039	四川路桥	144,150	472,812.00	0.19
219	601100	恒立液压	23,700	469,497.00	0.19
220	600307	酒钢宏兴	244,700	467,377.00	0.19
221	002701	奥瑞金	91,953	465,282.18	0.19
222	601880	大连港	249,422	461,430.70	0.19
223	600409	三友化工	80,602	461,043.44	0.19
224	600823	世茂股份	122,200	459,472.00	0.19
225	002368	太极股份	19,741	457,991.20	0.19
226	002030	达安基因	45,064	457,850.24	0.19
227	600970	中材国际	83,550	457,018.50	0.19
228	600525	长园集团	103,497	453,316.86	0.18
229	300058	蓝色光标	104,100	451,794.00	0.18
230	603816	顾家家居	10,000	450,000.00	0.18
231	002690	美亚光电	21,100	449,008.00	0.18
232	600563	法拉电子	10,623	447,653.22	0.18
233	600787	中储股份	88,634	443,170.00	0.18
234	002672	东江环保	38,737	443,151.28	0.18
235	600582	天地科技	129,345	442,359.90	0.18
236	000563	陕国投 A	163,932	439,337.76	0.18
237	300182	捷成股份	101,500	435,435.00	0.18
238	600881	亚泰集团	130,868	433,173.08	0.18
239	000738	航发控制	35,800	431,748.00	0.18
240	300026	红日药业	141,100	430,355.00	0.17
241	000031	中粮地产	88,083	429,845.04	0.17
242	000400	许继电气	48,300	429,387.00	0.17
243	600120	浙江东方	34,153	428,961.68	0.17
244	600645	中源协和	26,400	428,736.00	0.17
245	002414	高德红外	19,650	423,457.50	0.17
246	300113	顺网科技	33,261	422,747.31	0.17
247	002285	世联行	83,200	422,656.00	0.17

248	002028	思源电气	42,524	419,711.88	0.17
249	600633	浙数文化	50,900	414,835.00	0.17
250	000543	皖能电力	86,451	414,100.29	0.17
251	600171	上海贝岭	44,062	411,539.08	0.17
252	600499	科达洁能	101,700	410,868.00	0.17
253	600017	日照港	148,707	410,431.32	0.17
254	002212	南洋股份	36,700	408,104.00	0.17
255	000006	深振业 A	78,207	405,112.26	0.16
256	000758	中色股份	110,700	404,055.00	0.16
257	002400	省广集团	136,246	403,288.16	0.16
258	600648	外高桥	29,200	401,208.00	0.16
259	600597	光明乳业	47,800	399,608.00	0.16
260	600179	安通控股	59,960	398,734.00	0.16
261	002280	联络互动	103,000	398,610.00	0.16
262	002444	巨星科技	41,995	398,112.60	0.16
263	300010	立思辰	54,600	396,396.00	0.16
264	002131	利欧股份	268,640	394,900.80	0.16
265	600216	浙江医药	45,300	393,204.00	0.16
266	000718	苏宁环球	123,600	393,048.00	0.16
267	300459	金科文化	52,800	388,080.00	0.16
268	000926	福星股份	63,325	387,549.00	0.16
269	600908	无锡银行	73,900	387,236.00	0.16
270	002839	张家港行	72,200	386,270.00	0.16
271	601717	郑煤机	69,805	386,021.65	0.16
272	002242	九阳股份	24,041	384,896.41	0.16
273	002064	华峰氨纶	91,722	384,315.18	0.16
274	600267	海正药业	45,800	384,262.00	0.16
275	002563	森马服饰	43,000	383,560.00	0.16
276	600073	上海梅林	51,276	382,006.20	0.16
277	600503	华丽家族	125,200	381,860.00	0.16
278	002366	台海核电	40,600	380,828.00	0.15
279	600978	宜华生活	92,654	379,881.40	0.15
280	002831	裕同科技	9,400	376,564.00	0.15
281	002317	众生药业	44,902	374,931.70	0.15
282	002233	塔牌集团	37,252	374,755.12	0.15
283	002426	胜利精密	161,300	374,216.00	0.15
284	000537	广宇发展	49,900	373,751.00	0.15
285	300055	万邦达	48,700	373,529.00	0.15
286	002254	泰和新材	34,244	371,204.96	0.15
287	000078	海王生物	124,077	369,749.46	0.15
288	000848	承德露露	45,886	368,923.44	0.15
289	600098	广州发展	65,100	368,466.00	0.15

290	600835	上海机电	25,246	367,329.30	0.15
291	002128	露天煤业	51,100	365,876.00	0.15
292	601200	上海环境	27,400	363,598.00	0.15
293	002573	清新环境	50,252	362,819.44	0.15
294	000156	华数传媒	45,600	361,608.00	0.15
295	600623	华谊集团	44,700	361,176.00	0.15
296	002807	江阴银行	70,700	359,156.00	0.15
297	002056	横店东磁	64,908	358,941.24	0.15
298	300002	神州泰岳	108,300	357,390.00	0.15
299	601678	滨化股份	84,540	356,758.80	0.14
300	603444	吉比特	2,400	355,200.00	0.14
301	000723	美锦能源	109,900	352,779.00	0.14
302	601608	中信重工	135,600	352,560.00	0.14
303	600141	兴发集团	34,118	351,074.22	0.14
304	600611	大众交通	87,887	350,669.13	0.14
305	000877	天山股份	49,248	350,153.28	0.14
306	300115	长盈精密	42,685	349,590.15	0.14
307	000519	中兵红箭	55,508	349,145.32	0.14
308	002359	北讯集团	42,500	348,925.00	0.14
309	000712	锦龙股份	38,300	347,764.00	0.14
310	002505	大康农业	214,270	347,117.40	0.14
311	600557	康缘药业	33,690	346,333.20	0.14
312	000012	南玻A	86,689	345,889.11	0.14
313	300199	翰宇药业	36,900	344,646.00	0.14
314	600869	智慧能源	70,854	343,641.90	0.14
315	300287	飞利信	90,800	343,224.00	0.14
316	600757	长江传媒	51,900	338,388.00	0.14
317	603766	隆鑫通用	82,518	337,498.62	0.14
318	600545	卓郎智能	45,242	334,790.80	0.14
319	002745	木林森	29,600	334,184.00	0.14
320	600750	江中药业	19,735	334,113.55	0.14
321	000021	深科技	57,956	333,247.00	0.14
322	600316	洪都航空	33,600	332,304.00	0.14
323	600859	王府井	24,349	330,172.44	0.13
324	603515	欧普照明	11,800	328,866.00	0.13
325	603658	安图生物	6,700	327,563.00	0.13
326	600751	海航科技	120,600	326,826.00	0.13
327	300244	迪安诊断	21,520	326,458.40	0.13
328	603228	景旺电子	6,500	324,935.00	0.13
329	600338	西藏珠峰	16,700	324,481.00	0.13
330	600580	卧龙电气	51,486	324,361.80	0.13
331	600575	皖江物流	151,800	323,334.00	0.13

332	600155	华创阳安	42,900	323,037.00	0.13
333	600565	迪马股份	124,200	322,920.00	0.13
334	300159	新研股份	70,000	322,700.00	0.13
335	300197	铁汉生态	84,400	319,876.00	0.13
336	600151	航天机电	80,200	317,592.00	0.13
337	600993	马应龙	23,624	317,034.08	0.13
338	600765	中航重机	42,595	316,906.80	0.13
339	600478	科力远	81,248	316,867.20	0.13
340	603883	老百姓	6,700	316,307.00	0.13
341	603000	人民网	43,200	315,360.00	0.13
342	600169	太原重工	140,200	312,646.00	0.13
343	000937	冀中能源	82,800	312,156.00	0.13
344	000727	华东科技	212,300	312,081.00	0.13
345	002517	恺英网络	84,100	312,011.00	0.13
346	600777	新潮能源	163,300	311,903.00	0.13
347	601801	皖新传媒	46,600	311,288.00	0.13
348	002332	仙琚制药	50,127	307,278.51	0.12
349	600874	创业环保	37,200	306,900.00	0.12
350	601016	节能风电	132,200	306,704.00	0.12
351	300376	易事特	72,800	306,488.00	0.12
352	002048	宁波华翔	29,372	306,349.96	0.12
353	002249	大洋电机	92,550	305,415.00	0.12
354	000426	兴业矿业	61,140	304,477.20	0.12
355	000612	焦作万方	76,462	302,789.52	0.12
356	300308	中际旭创	7,400	301,106.00	0.12
357	600195	中牧股份	28,228	300,345.92	0.12
358	601003	柳钢股份	45,700	300,249.00	0.12
359	002431	棕榈股份	83,580	298,380.60	0.12
360	601311	骆驼股份	33,654	297,164.82	0.12
361	600614	鹏起科技	82,688	296,849.92	0.12
362	000062	深圳华强	17,700	294,882.00	0.12
363	600770	综艺股份	62,475	294,257.25	0.12
364	000061	农产品	60,600	293,910.00	0.12
365	000158	常山北明	56,300	293,886.00	0.12
366	000600	建投能源	58,400	293,168.00	0.12
367	002424	贵州百灵	33,400	292,250.00	0.12
368	000501	鄂武商 A	30,785	291,841.80	0.12
369	002482	广田集团	50,200	290,658.00	0.12
370	002709	天赐材料	13,400	290,244.00	0.12
371	002544	杰赛科技	26,800	289,976.00	0.12
372	002512	达华智能	54,300	288,333.00	0.12
373	002093	国脉科技	39,350	286,861.50	0.12

374	002815	崇达技术	19,600	286,356.00	0.12
375	300134	大富科技	30,030	282,282.00	0.11
376	002390	信邦制药	68,400	279,756.00	0.11
377	601001	大同煤业	65,500	279,685.00	0.11
378	600694	大商股份	11,500	278,185.00	0.11
379	002434	万里扬	42,200	278,098.00	0.11
380	002509	天广中茂	116,800	276,816.00	0.11
381	600329	中新药业	22,162	275,695.28	0.11
382	000049	德赛电池	9,608	275,557.44	0.11
383	600366	宁波韵升	54,824	274,668.24	0.11
384	600122	宏图高科	75,582	274,362.66	0.11
385	600416	湘电股份	53,021	273,588.36	0.11
386	600657	信达地产	69,600	273,528.00	0.11
387	600594	益佰制药	49,500	273,240.00	0.11
388	000564	供销大集	107,300	271,469.00	0.11
389	600259	广晟有色	12,131	271,249.16	0.11
390	300257	开山股份	26,800	267,732.00	0.11
391	000541	佛山照明	51,647	267,531.46	0.11
392	603568	伟明环保	11,700	267,345.00	0.11
393	600640	号百控股	27,200	266,832.00	0.11
394	600754	锦江股份	12,500	266,250.00	0.11
395	603198	迎驾贡酒	18,800	265,268.00	0.11
396	600053	九鼎投资	11,200	263,648.00	0.11
397	002375	亚厦股份	52,300	263,592.00	0.11
398	002635	安洁科技	23,253	263,456.49	0.11
399	002302	西部建设	29,800	263,432.00	0.11
400	600350	山东高速	57,500	262,200.00	0.11
401	000090	天健集团	56,925	261,855.00	0.11
402	600759	洲际油气	110,000	259,600.00	0.11
403	300266	兴源环境	73,300	258,749.00	0.11
404	601689	拓普集团	17,300	255,694.00	0.10
405	600748	上实发展	47,300	252,582.00	0.10
406	002277	友阿股份	79,682	251,795.12	0.10
407	002707	众信旅游	39,800	251,536.00	0.10
408	002503	搜于特	106,800	250,980.00	0.10
409	002276	万马股份	49,401	248,981.04	0.10
410	601127	小康股份	14,500	248,530.00	0.10
411	603866	桃李面包	5,500	248,380.00	0.10
412	603659	璞泰来	5,200	246,480.00	0.10
413	600086	东方金钰	53,322	245,814.42	0.10
414	600773	西藏城投	40,300	241,800.00	0.10
415	603806	福斯特	9,000	241,200.00	0.10

416	600058	五矿发展	36,700	238,917.00	0.10
417	002344	海宁皮城	52,500	238,875.00	0.10
418	600428	中远海特	73,400	238,550.00	0.10
419	002818	富森美	11,400	237,006.00	0.10
420	000990	诚志股份	19,600	235,396.00	0.10
421	603328	依顿电子	23,608	233,719.20	0.09
422	002002	鸿达兴业	80,838	232,813.44	0.09
423	000829	天音控股	41,397	232,237.17	0.09
424	600639	浦东金桥	20,600	231,956.00	0.09
425	300297	蓝盾股份	46,300	231,500.00	0.09
426	600240	华业资本	88,954	230,390.86	0.09
427	002354	天神娱乐	43,920	230,140.80	0.09
428	000552	靖远煤电	89,318	228,654.08	0.09
429	002477	雏鹰农牧	152,012	228,018.00	0.09
430	603888	新华网	17,700	227,268.00	0.09
431	600006	东风汽车	62,543	225,154.80	0.09
432	002489	浙江永强	85,029	224,476.56	0.09
433	002665	首航节能	79,305	222,847.05	0.09
434	603377	东方时尚	15,100	220,460.00	0.09
435	600971	恒源煤电	39,122	220,256.86	0.09
436	000969	安泰科技	48,074	218,736.70	0.09
437	000980	众泰汽车	50,300	217,799.00	0.09
438	002663	普邦股份	88,100	217,607.00	0.09
439	600939	重庆建工	46,500	214,365.00	0.09
440	600458	时代新材	31,390	212,824.20	0.09
441	000766	通化金马	30,500	209,230.00	0.09
442	000587	金洲慈航	87,300	205,155.00	0.08
443	002251	步步高	27,399	203,300.58	0.08
444	000536	华映科技	108,100	202,147.00	0.08
445	002642	荣之联	31,300	201,572.00	0.08
446	603556	海兴电力	15,460	200,980.00	0.08
447	600335	国机汽车	32,208	200,977.92	0.08
448	601777	力帆股份	51,528	196,321.68	0.08
449	600126	杭钢股份	43,300	195,283.00	0.08
450	002437	誉衡药业	68,655	192,234.00	0.08
451	002308	威创股份	43,159	192,057.55	0.08
452	002416	爱施德	31,700	186,396.00	0.08
453	600743	华远地产	76,800	185,856.00	0.08
454	600393	粤泰股份	86,800	184,016.00	0.07
455	600862	中航高科	32,700	183,120.00	0.07
456	601019	山东出版	23,200	181,424.00	0.07
457	300156	神雾环保	49,500	179,685.00	0.07

458	002681	奋达科技	48,457	177,352.62	0.07
459	600167	联美控股	19,600	177,184.00	0.07
460	603225	新凤鸣	9,400	176,250.00	0.07
461	002588	史丹利	45,220	175,905.80	0.07
462	002118	紫鑫药业	39,996	174,382.56	0.07
463	600699	均胜电子	7,400	172,864.00	0.07
464	000987	越秀金控	21,500	171,355.00	0.07
465	600184	光电股份	17,400	169,998.00	0.07
466	600996	贵广网络	26,700	169,812.00	0.07
467	002345	潮宏基	36,434	162,859.98	0.07
468	002041	登海种业	30,100	162,239.00	0.07
469	601326	秦港股份	51,000	160,140.00	0.07
470	603233	大参林	3,900	155,454.00	0.06
471	002699	美盛文化	28,360	155,412.80	0.06
472	300291	华录百纳	34,700	154,415.00	0.06
473	603169	兰石重装	36,000	153,720.00	0.06
474	603868	飞科电器	4,000	152,720.00	0.06
475	002920	德赛西威	8,800	152,680.00	0.06
476	601969	海南矿业	33,400	149,632.00	0.06
477	603355	莱克电气	6,900	148,350.00	0.06
478	600280	中央商场	44,932	146,029.00	0.06
479	601005	重庆钢铁	74,800	145,112.00	0.06
480	600687	刚泰控股	34,900	144,835.00	0.06
481	300347	泰格医药	3,300	141,075.00	0.06
482	300202	聚龙股份	21,722	139,889.68	0.06
483	000761	本钢板材	38,600	129,696.00	0.05
484	601811	新华文轩	13,600	126,616.00	0.05
485	600618	氯碱化工	19,300	125,257.00	0.05
486	000025	特力A	4,600	121,992.00	0.05
487	002147	ST新光	38,290	118,699.00	0.05
488	601020	华钰矿业	13,500	114,210.00	0.05
489	600917	重庆燃气	14,600	103,952.00	0.04
490	603025	大豪科技	8,600	95,890.00	0.04
491	603877	太平鸟	4,900	92,071.00	0.04
492	603569	长久物流	6,700	72,025.00	0.03
493	000693	*ST华泽	19,205	10,562.75	0.00

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	600901	江苏租赁	80,000	472,800.00	0.19

2	601869	长飞光纤	7,200	286,344.00	0.12
3	601990	南京证券	27,000	234,900.00	0.10
4	603486	科沃斯	3,900	179,517.00	0.07
5	603712	七一二	8,900	158,509.00	0.06
6	603056	德邦股份	9,100	150,605.00	0.06
7	603650	彤程新材	5,700	113,031.00	0.05
8	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.03
9	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.02
10	603629	利通电子	1,051	40,684.21	0.02

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	000661	长春高新	3,408,961.00	1.06
2	600760	中航沈飞	3,252,007.00	1.01
3	002299	圣农发展	2,929,725.00	0.91
4	002371	北方华创	2,815,820.64	0.88
5	002110	三钢闽光	2,776,708.00	0.87
6	000636	风华高科	2,416,629.00	0.75
7	600808	马钢股份	2,259,599.00	0.70
8	300253	卫宁健康	2,111,565.00	0.66
9	300308	中际旭创	1,821,095.23	0.57
10	002179	中航光电	1,785,119.00	0.56
11	002049	紫光国微	1,770,242.00	0.55
12	603589	口子窖	1,731,078.00	0.54
13	002353	杰瑞股份	1,676,048.00	0.52
14	600176	中国巨石	1,645,879.00	0.51
15	600516	方大炭素	1,623,862.00	0.51
16	600282	南钢股份	1,563,487.00	0.49
17	600438	通威股份	1,465,509.00	0.46
18	600801	华新水泥	1,448,086.00	0.45
19	600004	白云机场	1,388,980.00	0.43
20	600258	首旅酒店	1,383,533.00	0.43

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	000661	长春高新	5,641,854.76	1.76
2	002001	新和成	3,071,573.63	0.96
3	002299	圣农发展	2,830,078.00	0.88

4	603019	中科曙光	2,787,735.00	0.87
5	002179	中航光电	2,752,339.88	0.86
6	600760	中航沈飞	2,739,887.00	0.85
7	002405	四维图新	2,581,902.52	0.80
8	600521	华海药业	2,493,242.04	0.78
9	002371	北方华创	2,486,186.00	0.77
10	002422	科伦药业	2,410,732.00	0.75
11	600516	方大炭素	2,355,648.00	0.73
12	000786	北新建材	2,243,372.88	0.70
13	603589	口子窖	2,217,033.00	0.69
14	002050	三花智控	2,110,280.87	0.66
15	600176	中国巨石	2,062,270.88	0.64
16	600808	马钢股份	2,028,580.00	0.63
17	002271	东方雨虹	2,007,050.12	0.63
18	000977	浪潮信息	1,866,097.00	0.58
19	002049	紫光国微	1,810,793.00	0.56
20	600004	白云机场	1,782,474.00	0.56

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	292,220,931.08
卖出股票收入(成交)总额	266,365,954.21

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所有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:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

8.10.2 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。

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 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收到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

8.12.2 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。

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	37,173.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,120.08
5	应收申购款	619,999.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	661, 292. 29
---	----	--------------

8.12.4 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。

8.12.5 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:无。

8.12.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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

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, 710	19, 594. 25	57, 664, 400. 16	21. 47	210, 972, 738. 07	78. 53

9.2 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	黄月明	277, 000. 00	3. 60
2	高炜	220, 300. 00	2. 86
3	深圳市博凯保健品有 限公司	200, 028. 00	2. 60
4	张宏旭	200, 012. 00	2. 60
5	施红梅	197, 014. 00	2. 56
6	卢翠馨	195, 030. 00	2. 54
7	陈吉荃	150, 042. 00	1. 95
8	罗丽珊	148, 425. 00	1. 93
9	鹿敏理	119, 003. 00	1. 55
10	俞富良	117, 026. 00	1. 52

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	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	254, 249. 03	0. 0946

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、基金投资和研究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

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	239,490,327.51
本报告期基金总申购份额	146,036,818.21
减:本报告期基金总赎回份额	116,890,007.49
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	268,637,138.23

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。

§ 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:报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本基金投资策略未发生改变

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 50,000.00 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 9 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	274,633,194.88	49.55%	253,831.64	49.76%	-
长江证券	1	145,750,091.71	26.29%	132,822.59	26.04%	-
银河证券	1	72,621,492.07	13.10%	67,630.22	13.26%	-
广发证券	1	61,285,946.65	11.06%	55,850.38	10.95%	-

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	95,881.03	100.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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参与中国国际金融股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年01月12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	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年01月17日
3	2017年第四季度报告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年01月22日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与湘财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》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年01月24日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年01月24日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海华信证券有限责任公司开展基金转换费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年01月30日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年02月02日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年02月03日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年02月06日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018年02月07日

	示性公告		
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 02 月 08 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 02 月 10 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 03 月 02 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 03 月 10 日
15	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 更新的招募说明书摘要	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 03 月 17 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 03 月 21 日
17	关于鹏华旗下 139 只基金修改基金合同的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 03 月 23 日
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 03 月 24 日
19	2017 年年度报告摘要	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 03 月 29 日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东莞农村商业银行股份有限公司手机银行基金认/申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 03 月 31 日
21	鹏华基金管理有限公司关于增加上海万得投资顾问有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 04 月 04 日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东海证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 04 月 09 日
23	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信建投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》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 04 月 09 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	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 04 月 11 日
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 04 月 14 日

	示性公告		
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 04 月 18 日
27	2018 年第一季度报告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 04 月 21 日
28	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 04 月 24 日
29	鹏华基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 04 月 27 日
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	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 05 月 09 日
31	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低转换份额和账户最低余额限制的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 05 月 09 日
32	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 05 月 11 日
33	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银河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》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 05 月 21 日
34	鹏华基金管理有限公司关于提请投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 05 月 28 日
35	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 05 月 29 日
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 05 月 31 日
37	鹏华基金管理有限公司关于提请非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 06 月 01 日
38	鹏华基金关于调整旗下部分基金单笔最低定投金额限制的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 06 月 08 日
39	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 06 月 12 日
40	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 06 月 15 日

41	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 06 月 16 日
42	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 06 月 20 日
43	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 06 月 22 日
44	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 06 月 22 日
45	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 06 月 27 日
46	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 06 月 28 日
47	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 06 月 29 日
48	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司网上银行渠道基金定投手续费率优惠的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 06 月 30 日
49	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 06 月 30 日
50	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 07 月 05 日
51	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 07 月 06 日
52	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 07 月 07 日
53	2018 年第二季度报告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 07 月 18 日
54	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 07 月 24 日
55	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金	《证券时报》、《中国证	2018 年 07 月 28 日

	持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	券报》、《上海证券报》	
56	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东北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》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 08 月 06 日
57	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与广发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》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 08 月 13 日
58	2018 年半年度报告摘要	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 08 月 27 日
59	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 09 月 01 日
60	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 09 月 06 日
61	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 09 月 07 日
62	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 09 月 12 日
63	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 更新的招募说明书摘要	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 09 月 15 日
64	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 09 月 22 日
65	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资申购费率优惠的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 09 月 29 日
66	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 10 月 12 日
67	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 10 月 17 日
68	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与众升财富（北京）基金销售有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 10 月 18 日
69	2018 年第三季度报告	《证券时报》、《中国证	2018 年 10 月 26 日

		券报》、《上海证券报》	
70	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 11 月 09 日
71	鹏华基金管理有限公司关于增加个人投资者开立基金账户的证件类型公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 11 月 15 日
72	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海浦东发展银行股份有限公司申购 (不含定期定额申购) 费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 12 月 08 日
73	鹏华基金管理有限公司关于增加北京百度百盈基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 12 月 18 日
74	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行“2019 倾心回馈”基金定投费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 12 月 28 日
75	鹏华基金关于旗下部分基金参与邮储银行个人网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 12 月 28 日
76	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 12 月 28 日
77	鹏华基金管理有限公司关于增设客服热线的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 12 月 29 日
78	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国农业银行个人网银和掌上银行基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2018 年 12 月 29 日

§ 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

注:无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足广大投资者的投资需求,鹏华基金管理有限公司根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金 运作管理办法》、《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定,经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,自 2019 年 1 月 22 日起对本公司管理的鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 增 C 类基金份额,并对该基金的基金合同进行相应修改。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》;
- (二)《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》;
- (三)《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2018 年度报告》(原文)。

13.2 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。

13.3 查阅方式

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

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

鹏华基金管理有限公司

2019 年 03 月 28 日