

# 鹏华中证银行指数分级证券投资基金 2019 年第 2 季度报告

2019 年 06 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 07 月 16 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 7 月 15 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 4 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

### 2.1 基金基本情况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 鹏华银行分级   |
| 场内简称       | 银行指基   |
| 基金主代码      | 160631   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2015 年 04 月 17 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 4,906,612,887.15 份   |
| 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， |

|                 |   |   |   |
|-----------------|---|---|---|
|                 | <p>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。本基金力争鹏华银行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。</p> |   |   |
| 业绩比较基准          | <p>中证银行指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%</p>  |   |   |
| 风险收益特征          | <p>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。</p>  |   |   |
| 基金管理人           | <p>鹏华基金管理有限公司</p>   |   |   |
| 基金托管人           | <p>中国建设银行股份有限公司</p>   |   |   |
| 下属分级基金的基金简称     | 鹏华银行分级  | 鹏华银行 A                                      | 鹏华银行 B                                      |
| 下属分级基金的场内简称     | 银行指基  | 银行 A  | 银行 B  |
| 下属分级基金的交易代码     | 160631  | 150227                                      | 150228                                      |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,093,702,925.15 份  | 1,906,454,981.00 份                          | 1,906,454,981.00 份                          |
| 下属分级基金的风险收益特征   | <p>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</p>  | <p>鹏华银行 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。</p> | <p>鹏华银行 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。</p> |

|  |                    |  |  |
|--|--------------------|--|--|
|  | 指数所代表的公司相似的风险收益特征。 |  |  |
|--|--------------------|--|--|

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期(2019年04月01日 - 2019年06月30日) |
|-----------------|--------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 83,376,716.11                  |
| 2. 本期利润         | 98,769,694.59                  |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0185                         |
| 4. 期末基金资产净值     | 4,704,010,093.92               |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.959                          |

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

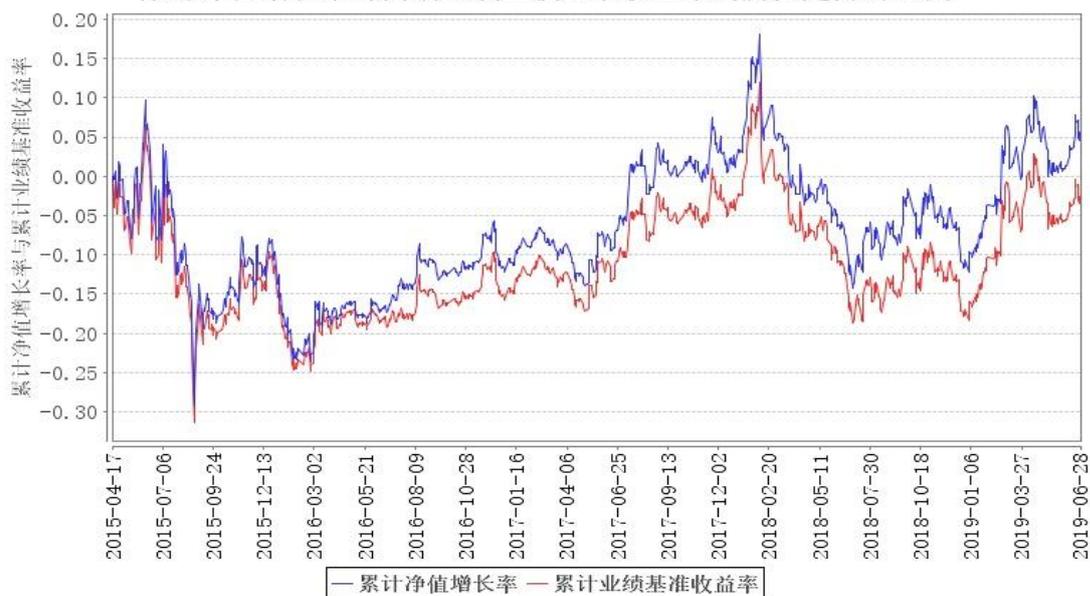
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标准差<br>④ | ①-③   | ②-④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 2.35%      | 1.14%         | 1.28%          | 1.13%                 | 1.07% | 0.01% |

注：业绩比较基准=中证银行指数收益率×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累计份额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

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 04 月 17 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务      | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|---------|-------------|------|--------|---|
|     |         | 任职日期        | 离任日期 |        |   |
| 崔俊杰 | 本基金基金经理 | 2015-04-17  | -    | 11 年   | 崔俊杰先生，国籍中国，管理学硕士，11 年证券基金从业经验。2008 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任产品规划部产品设计师、量化及衍生品投资部量化研究员，先后从事产品设计、量化研究工作，现任量化及衍生品投资部副总经理、基金经理。2013 年 03 月担任鹏华深证民营 ETF 基金基金经理，2013 年 03 月担任鹏华深证民营 ETF 联接基金基金 |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>经理，2013 年 03 月担任鹏华上证民企 50ETF 联接基金基金经理，2013 年 03 月担任鹏华上证民企 50ETF 基金基金经理，2013 年 07 月至 2018 年 02 月担任鹏华沪深 300ETF 基金基金经理，2014 年 12 月担任鹏华资源分级基金基金经理，2014 年 12 月担任鹏华传媒分级基金基金经理，2015 年 04 月担任鹏华银行分级基金基金经理，2015 年 08 月至 2016 年 07 月担任鹏华医药分级基金基金经理，2016 年 07 月担任鹏华医药指数 (LOF) 基金基金经理，2016 年 11 月担任鹏华香港银行指数 (LOF) 基金基金经理，2018 年 02 月至 2018 年 03 月担任鹏华量化先锋混合基金基金经理。崔俊杰先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。</p> |
|--|--|--|--|---|

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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

过该证券当日成交量的 5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年第二季度，整个 A 股市场波动剧烈，市场先扬后抑，波动率和成交量均环比下降。本基金秉承指数基金的投资策略，在应对申购赎回的基础上，力争跟踪指数收益，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

2019 年第二季度本基金申购赎回较为频繁，对基金的管理运作带来一定影响，面临这种情况，我们进行了精心的管理，较好的实现了跟踪误差控制目标。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，鹏华银行分级组合净值增长率 2.35%；基金年化跟踪误差 1.79%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                        | 金额（人民币元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|---------------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资                      | 4,455,266,650.82 | 94.23        |
|    | 其中：股票                     | 4,455,266,650.82 | 94.23        |
| 2  | 基金投资                      | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资                    | -                | -            |
|    | 其中：债券                     | -                | -            |
|    | 资产支持<br>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<br>购的买入返售金<br>融资产 | -                | -            |
| 7  | 银行存款和结算<br>备付金合计          | 250,368,102.56   | 5.30         |
| 8  | 其他资产                      | 22,478,768.02    | 0.48         |
| 9  | 合计                        | 4,728,113,521.40 | 100.00       |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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              | 4,454,663,601.93 | 94.70        |
| K  | 房地产业             | -                | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -                | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -                | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -                | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -            |
| P  | 教育               | -                | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -                | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -                | -            |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 4,454,663,601.93 | 94.70        |

### 5.2.2 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              | 363,431.25 | 0.01         |
| C  | 制造业              | 176,907.28 | 0.00         |
| 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         | 39,603.76  | 0.00         |

|   |               |            |      |
|---|---------------|------------|------|
|   | 信息技术服务业       |            |      |
| J | 金融业           | -          | -    |
| K | 房地产业          | -          | -    |
| L | 租赁和商务服务业      | -          | -    |
| M | 科学研究和技术服务业    | -          | -    |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | -          | -    |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -          | -    |
| P | 教育            | -          | -    |
| Q | 卫生和社会工作       | -          | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 23,106.60  | 0.00 |
| S | 综合            | -          | -    |
|   | 合计            | 603,048.89 | 0.01 |

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 5.3 报告期末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

#### 5.3.1 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

| 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  | 600036 | 招商银行 | 18,915,987 | 680,597,212.26 | 14.47        |
| 2  | 601166 | 兴业银行 | 30,902,680 | 565,210,017.20 | 12.02        |
| 3  | 601328 | 交通银行 | 58,387,754 | 357,333,054.48 | 7.60         |
| 4  | 600016 | 民生银行 | 52,751,759 | 334,973,669.65 | 7.12         |
| 5  | 601288 | 农业银行 | 81,410,079 | 293,076,284.40 | 6.23         |
| 6  | 600000 | 浦发银行 | 24,950,182 | 291,418,125.76 | 6.20         |
| 7  | 601398 | 工商银行 | 45,835,643 | 269,971,937.27 | 5.74         |
| 8  | 000001 | 平安银行 | 18,244,228 | 251,405,461.84 | 5.34         |
| 9  | 601169 | 北京银行 | 31,451,266 | 185,876,982.06 | 3.95         |
| 10 | 601988 | 中国银行 | 44,789,243 | 167,511,768.82 | 3.56         |

#### 5.3.2 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

| 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  | 600968 | 海油发展 | 102,375 | 363,431.25 | 0.01         |
| 2  | 300782 | 卓胜微  | 743     | 80,927.56  | 0.00         |
| 3  | 601698 | 中国卫通 | 10,103  | 39,603.76  | 0.00         |
| 4  | 603863 | 松炆资源 | 1,612   | 37,204.96  | 0.00         |
| 5  | 300594 | 朗进科技 | 721     | 31,803.31  | 0.00         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

#### 5.5 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债券投资明细

无。

#### 5.6 报告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

无。

#### 5.7 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

无。

#### 5.8 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权证投资明细

无。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未发生股指期货投资。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 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。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

##### 5.10.3 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。

#### 5.11 投资组合报告附注

##### 5.11.1

民生银行

本组合投资的前十名证券之一中国民生银行股份有限公司，收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚如下：

行政处罚决定书文号 《银保监银罚决字〔2018〕5号》

被处罚当事人姓名或名称：中国民生银行股份有限公司

主要违法违规事实：贷款业务严重违反审慎经营规则。

行政处罚依据：《商业银行授信工作尽职指引》第十五条、第二十八条，《流动资金贷款管理暂行办法》第九条、第十三条，《固定资产贷款管理暂行办法》第七条、第二十八条、第三十条、第三十三条，《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条。

行政处罚决定：罚款 200 万元。

作出处罚决定的机关：中国银行保险监督管理委员会

作出处罚决定的日期：2018 年 11 月 9 日

行政处罚决定书文号 《银保监银罚决字〔2018〕8 号》

被处罚当事人姓名或名称：中国民生银行股份有限公司

主要违法违规事实：

- （一）内控管理严重违反审慎经营规则；
- （二）同业投资违规接受担保；
- （三）同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；
- （四）本行理财产品之间风险隔离不到位；
- （五）个人理财资金违规投资；
- （六）票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；
- （七）为非保本理财产品提供保本承诺。

行政处罚依据：

（一）《商业银行内部控制指引》第五条、第十五条，《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条；

（二）《关于规范金融机构同业业务的通知》第七条，《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条；

（三）《商业银行房地产贷款风险管理指引》第十五条，《中国人民银行 中国银行业监督管理委员会关于加强商业性房地产信贷管理的通知》第二条，《中国人民银行 中国银行业监督管理委员会关于金融促进节约集约用地的通知》第二条，《中国银监会关于规范商业银行理财业务投资运作有关问题的通知》第四条，《关于规范土地储备和资金管理等相关问题的通知》第五条，《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条；

（四）《中国银监会关于完善银行理财业务组织管理体系有关事项的通知》第三条，《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条；

（五）《中国银监会关于进一步规范商业银行个人理财业务投资管理有关问题的通知》第四条、第十八条、第十九条，《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条；

（六）《商业银行资本管理办法（试行）》第五十三条，《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条；

（七）《商业银行理财产品销售管理办法》第十三条、第三十七条，《关于规范金融机构同业业务的通知》第七条，《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条。

行政处罚决定：罚款 3160 万元。

作出处罚决定的机关：中国银行保险监督管理委员会

作出处罚决定的日期：2018 年 11 月 9 日

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。

#### 平安银行

平安银行收到银监局于 2018 年 8 月 3 日的处罚决定，具体情况说明如下：

平安银行因贷前调查不到位，向环保未达标的企业提供融资、贷后管理失职，流动资金贷款被挪用等，罚款 30 万元。

#### 浦发银行

2018 年 7 月 26 日，中国人民银行发布银反洗罚决字〔2018〕3 号，内容如下：

2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日，浦发银行未按照规定履行客户身份识别义务，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（一）项规定，处以 50 万元罚款；未按照规定保存客户身份资料和交易记录，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（二）项规定，处以 30 万元罚款；未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（三）项规定，处以 50 万元罚款；存在与身份不明的客户进行交易的行为，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（四）项规定，处以 40 万元罚款；对浦发银行合计处以 170 万元罚款，并根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（一）项、第（二）项、第（三）项和第（四）项规定，对相关责任人共处以 18 万元罚款。

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。

### 5.11.2

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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（人民币元）      |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 764,081.88    |
| 2  | 应收证券清算款 | 19,370,432.12 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 53,122.43     |
| 5  | 应收申购款   | 2,291,131.59  |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 22,478,768.02 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 5.11.5 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 5.11.6 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 5.11.7 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 鹏华银行分级           | 鹏华银行 A           | 鹏华银行 B           |
|---------------------------|------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 1,090,274,893.50 | 2,077,571,587.00 | 2,077,571,587.00 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 466,411,740.59   | -                | -                |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 805,216,920.94   | -                | -                |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 342,233,212.00   | -171,116,606.00  | -171,116,606.00  |
| 报告期期末基金份额总额               | 1,093,702,925.15 | 1,906,454,981.00 | 1,906,454,981.00 |

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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

无。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证银行指数分级证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华中证银行指数分级证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华中证银行指数分级证券投资基金 2019 年第 2 季度报告》（原文）。

### 9.2 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。

### 9.3 查阅方式

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

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

鹏华基金管理有限公司  
2019 年 07 月 16 日