# 鹏华中证国防指数分级证券投资基金 2019 年第 4 季度报告

2019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

报告送出日期: 2020年1月20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 2020 年 01 月 17 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 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	鹏华国防分级
场内简称	国防分级
基金主代码	160630
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年11月13日
报告期末基金份额总额	8, 656, 984, 524. 76 份
	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
投资目标	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。
	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
投资策略	踪误差。 本基金力争鹏华国防份额净值增长率与同期业绩比较

偏函度不超过0.35% 在盟腔提美不超过。				
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%。				
整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差	差			
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。				
中证国防指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×				
5%				
金,其预期的风险与收益高于混合型基金	金、			
场基金,为证券投资基金中较高风险、较	交高			
时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数	枚表			
以及标的指数所代表的公司相似的风险收	女益			
特征。				
鹏华基金管理有限公司				
中国建设银行股份有限公司				
鹏华国防 A 鹏华国防 B				
国防 A 国防 B				
150205 150206				
1, 136, 451, 945. 00 1, 136, 451, 945	. 00			
份份份				
Ž,				
高				
型基				
7证 咖化国际 A 小箭头 咖 化国际 B 小菊	名十			
<b>☆</b> 、				
同				
通				
量相对软低的特位。 具	14年。			
的				
似				
	管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、 ×95%+商业银行活期存款利率(税后) 金,其预期的风险与收益高于混合型基金 易基金,为证券投资基金中较高风险、转对本基金为指数基金,通过跟踪标的指数从及标的指数所代表的公司相似的风险收置 国限公司			

注:无。

## §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10月1日-2019年12月31日)
1. 本期已实现收益	-81, 615, 507. 46
2. 本期利润	135, 106, 102. 56
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0168
4. 期末基金资产净值	6, 547, 915, 935. 54
5. 期末基金份额净值	0.756

- 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①	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	2.06%	1.04%	1.48%	1.06%	0. 58%	-0.02%

注:业绩比较基准=中证国防指数收益率×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





#### 鹏华国防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 2014年11月13日生效。
- 2、截至建仓期结束,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

## 3.3 其他指标

注:无。

# § 4 管理人报告

## 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

111	+ <i>5</i> 7	田 夕	任本基金的基	基金经理期限	江光耳小左阳	3只 HB
<u> </u>	姓名    职务		任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
区	トル	本基金基金 经理	2019-03-19		10 年	陈卷年证经州司师月金司稽程是投充生,10年,金曾教工9月金司稽总化资总额。 11 从任件程年上,2009期有任金时行量的,2009期有任金时行量,12 上级的人工,2 上处处,2 上处,2 上

工程、量化, 完全 经 记			
常等工作。報告 完等工作。報告 品投资部監 基金经理。 2015年09月至2018年09月至2018年中の7月至2018年中の7月至2018年中の4月担任聯络企益。 全经理,2016年の9月至2018年の9月至2018年の9月至2018年の4月担任邮络中心。 会经理,2016年的9月至2018年中の9月至2018年中の1月担任聯华查指数 全经理,2016年10月至2018年01月担任聯华百0年10月至2018年04月联络基金经理,2019年01月担任聯华百0基金经理。2019年03月担任聯华百0年10日月担任聯华百0年10日月担任聯华百0年01日月担任聯华金是2019年10日,第十年1日期 例分级基金经理,2019年1日,1日日,1日日,1日日,1日日,1日日,1日日,1日日,1日日,1日日,			先后从事金融
任量化及衍生化研究副总监、基金经理。2015年中9月至2018年中9月至2018年中9月至2018年06月担任鹏华金基金经理。2016年07月至2018年04月担任于广大公安基金经理。2016年09月至2018年中4月担任于广大公安基金经理。2016年中69月至2018年中69月至2018年中6月至2018年中6月至2018年中6月至2018年中6月月至2018年中6月月至2018年中6月月至2018年中6月月至2018年中6月月至2018年中6月日日时分级基金经理。2019年3月月日日时分级基金基金经理。2019年3月日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日日			工程、量化研
品投资部量低、基金经理。 2015年09月至2018年05月担任鹏华钢装公级基金基金经理,2016年07月至2018年04月至07月至2018年04月担任鹏华金基金经理,2016年09月至2018年04月担任哪华基金经理,2016年09月至2018年04月担任鹏华香港级上分级基金基金经理,2016年10月至2018年04月期任日惠华国际分级基金基金经理,2019年03月担任歌华重基金经理,2019年03月担任野华重基基金经理,2019年03月担任耶华全天一位,2019年03月担任耶华全天一位,2019年03月担任耶华全天一位,2019年03月担任耶华全天一位,2019年03月担任耶华全天一位,2019年03月担任耶华全天一位,2019年03月担任耶华全天一位,2019年03月担任耶华全天一位,2019年03月担任耶华全天一位,2019年03月担任阿华全天一位,2019年03月担任阿华全天一位,2019年03月担任阿华全天一位,2019年03月担任阿华全天一位,2019年03月担任阿华全天一位,2019年03月担任阿华全天一位,2019年03月担任阿华全天一位,2019年03月担任阿华全天一位,2019年03月担任阿华全天一位,2019年03月担任阿华全天一位,2019年03月担任阿华全天一位,2019年03月担任阿华全天一位,2019年03日,2019年03月20日,2019年03月20日,2019年03月20日,2019年03月20日,2019年03月20日,2019年03月20日,2019年03月20日,2019年03月20日,2019年03日,2019年03月20日,2019年03日,2019年03日,2019年03日,2019年03日,2019年03日,2019年03日,2019年03日,2019年03日,2019年03日,2019年03日,2019年03日,2019年10日,2019年1			究等工作,现
研究副意监、基金经理。 2015年09月至2018年06 月担任鹏华翰 转分级基金基金经理,2016年07月至 2018年04月担任鹏华创业板分级基金基金经理,2016年09月至 2018年04月担任鹏华电小个分级基金基金经理。2016年09月至2018年04月担任鹏华香港中小企业指数(1.0F)基金基金经理,2016年10月至2018年04月职任第4年现,2016年10月担任解华互联举金经理。2019年03月担任解华金基金经理。2019年03月担任解华金基金经理。2019年03月担任耶华空天一体军工指数(1.0F)基金基金经理,2019年03月担任			任量化及衍生
研究副意监、基金经理。 2015年09月至2018年06 月担任鹏华翰 转分级基金基金经理,2016年07月至 2018年04月担任鹏华创业板分级基金基金经理,2016年09月至 2018年04月担任鹏华电小个分级基金基金经理。2016年09月至2018年04月担任鹏华香港中小企业指数(1.0F)基金基金经理,2016年10月至2018年04月职任第4年现,2016年10月担任解华互联举金经理。2019年03月担任解华金基金经理。2019年03月担任解华金基金经理。2019年03月担任耶华空天一体军工指数(1.0F)基金基金经理,2019年03月担任			品投资部量化
2015 年 09 月 至 2018 年 05 月月 任任 鹏华运基 金经理,2016 年 07 月至 2018 年 04 月 担任哪华创业 板分级基金基金经理。2016 年 09 月至 2018 年 04 月 担任哪络企业 2018 年 04 月 担任哪络企业 2018 年 04 月 担任哪络企业 2018 年 05 月 担任 鹏华香港中小企业指数 (LOF)基金是 2018 年 01 月 担任哪络企业 2018 年 01 月 担任哪络企业 2019 年 03 月 担任 鹏华国际分级基金基金经理。2019 年 03 月 担任 鹏华运基金经理,2019 年 04 月 担任 鹏华运基金经理,2019 年 05 月 担任 鹏华运基金经理,2019 年 10 月 担任 鹏华运基金经理,2019 年 10 月 担任 鹏华运基金经理,2019 年 10 月 担任 8 日本企业 2019 年 10 月 日本企业 2019 年 10 月 担任 8 日本企业 2019 年 10 月 日本企业 2019 年 10 日本企业 2019 年 10 月 日本企业 2019 年 10 日本企业 2019 年 10 月 日本企业 2019 年 10 月 日本企业 2019 年 10 月 日本企业 2019 年 1			
2015 年 09 月 至 2018 年 05 月月 任任 鹏华运基 金经理,2016 年 07 月至 2018 年 04 月 担任哪华创业 板分级基金基金经理。2016 年 09 月至 2018 年 04 月 担任哪络企业 2018 年 04 月 担任哪络企业 2018 年 04 月 担任哪络企业 2018 年 05 月 担任 鹏华香港中小企业指数 (LOF)基金是 2018 年 01 月 担任哪络企业 2018 年 01 月 担任哪络企业 2019 年 03 月 担任 鹏华国际分级基金基金经理。2019 年 03 月 担任 鹏华运基金经理,2019 年 04 月 担任 鹏华运基金经理,2019 年 05 月 担任 鹏华运基金经理,2019 年 10 月 担任 鹏华运基金经理,2019 年 10 月 担任 鹏华运基金经理,2019 年 10 月 担任 8 日本企业 2019 年 10 月 日本企业 2019 年 10 月 担任 8 日本企业 2019 年 10 月 日本企业 2019 年 10 日本企业 2019 年 10 月 日本企业 2019 年 10 日本企业 2019 年 10 月 日本企业 2019 年 10 月 日本企业 2019 年 10 月 日本企业 2019 年 1			
至 2018 年 05 月担任鹏华钢铁分级基金基金经理, 2016 年 07 月至 2018 年 04 月担任鹏华创业板分级基金基金经理, 2016 年 09 月至 2018 年 04 月担任鹏华地产分级基金基金经理, 2016 年 09 月至 2018 年 05 月担任,鹏华香港中小企业指数 (LOF) 基金基金经理, 2016 年 10 月至 2018 年 04 月 担任縣华国,至 2018 年 04 月 担任縣华国,所分级基金基。经理, 2019 年 03 月担任,鹏华国际分级基金基。经理, 2019 年 03 月担任,鹏华国、参分级基金基金经理, 2019 年 03 月担任,第华至工指数(LOF) 基金基金经理,2019 年 03 月担任,鹏华军工指数(LOF) 基金基金经理,2019 年 10 3 月担任,			
月担任鹏华钢铁分级基。基金经理、2016年 07 月至 2018年 04 月 担任鹏华创业板分级基金基金经理,2016年 09 月至 2018年 04 月 担任鹏华地产分级基金基金经理,2016年 09 月至 2018年 04 月 担任鹏华者数 (LOF) 基金基金经理,2016年 10 月至 2018年 04 月担任鹏华互联 06 分级基金基金经理,2019年 03 月担任鹏华面经 2018年 04 月担任鹏华面经 2018年 04 月担任鹏华面联 2019年 03 月担任 10 号 20 号			
供分级基金基金经理,2016年07月至2018年04月担任鹏华创业板分级基金查经理。2016年09月至2018年04月担任哪华地一个分级基金基金经理。2016年09月至2018年05月担任哪华香港中小企业指数(LDF)基金基金经理,2016年10月至2018年01月担任鹏华互联网分级基金基金经理。2019年03月担任哪华国防分级基金基金经理。2019年03月担任哪华证券分级基金基金经理。2019年03月担任哪华证券分级基金基金经理。2019年03月担任哪华证券分级基金基金经理。2019年03月担任哪年空天上指数(LDF)基金基金任军工指数(LDF)基金基金			
金经理, 2016年07月至 2018年04月担任哪华创业 板分级基金基金经理, 2016年09月至 2018年04月担任哪华地产分级基金基经理, 2016年09月至 2018年05月担任 鹏华香播教 (LOF)基金基金经理, 2016年10月至 2018年04月担任哪华正联网分级基金经理, 2019年03月担任 鹏华国际分级基金经理, 2019年03月担任 鹏华国际分级基金经理, 2019年03月担任 鹏华国际分级基金经理, 2019年03月担任 鹏华国际分级基金经理, 2019年03月担任 鹏华国联络空天一体军工指数 (LOF)基金基			
年 07 月至 2018 年 04 月 担任鹏华创业 板分级基金基金经理, 2016 年 09 月至 2018 年 04 月 担任哪华地产分级基金基金经理, 2016 年 09 月至 2018 年 05 月担任哪华生指数 (LoF)基金基金经理, 2016 年 10 月至 2018 年 04 月 担任哪件全商数 金经理, 2019 年 03 月担任 鹏华国防分级基金基金经理, 2019 年 03 月担任 鹏华军正指数 金经理、30 月担任 鹏华空天一体军工指数 (LoF)基金基			
2018 年 04 月 担任鹏华创业 板分级基金基 金经理, 2016 年 09 月至 2018 年 01 月 担任鹏华地产 分级基。基金 经理, 2016 年 05 月担任 鹏华香港中小 企业指数 (LOF)基金基 金经理, 2016 年 10 月至 2018 年 04 月 担任鹏华互联 网分级基金基 金经理, 2019 年 03 月担任 鹏华国等分级基金基 全经理, 2019 年 03 月担任 鹏华证 券分级基金基 金经理, 2019 年 03 月担任			
担任鹏华创业 板分级基金基金经理,2016年09月至2018年04月担任鹏华地产分级基金基金经理,2016年09月至2018年05月担任鹏华者教(LOF)基金基金经理,2016年10月至2018年04月担任鹏华互联网分级基金基金经理,2019年03月担任鹏华国际分级基金基金经理,2019年03月担任鹏华证券分级基金基金经理,2019年03月担任鹏华证券分级基金基金经理,2019年03月担任鹏华证券分级基金基金经理,2019年03月担任鹏华正括教			
板分级基金基金经理,2016年09月至2018年04月担任鹏华地产分级基金基金经理,2016年09月至2018年05月担任鹏华香港中小企业指数((LOF)基金基金经理,2016年10月至2018年04月担任鹏华互联网分级基金基金经理,2019年03月担任鹏华国防分级基金基金经理,2019年03月担任鹏华军等分级基金基金经理,2019年03月担任鹏华正券分级基金基金经理,2019年03月担任鹏华正券分级基金基金经理,2019年03月担任			
金经理, 2016年09月至2018年04月担任鹏华地产分级基金基金经理, 2016年09月至2018年05月担任鹏华香港中小企业指数(1.0F)基金基金经理, 2016年10月至2018年04月期任哪华互约级基金基金经理, 2019年03月担任鹏华国防分级基金金经理, 2019年03月担任鹏华证券分级基金基金经理, 2019年03月担任鹏华证券分级基金基金经理, 2019年03月担任鹏华证券分级基金基金经理, 2019年03月担任鹏华证券分级基金基金经理, 2019年03月担任鹏华证券分级基金基金经理, 2019年03月担任鹏华正者数			
年 09 月至 2018 年 04 月 担任鹏华地产分级基金基金经理, 2016 年 09 月至 2018 年 05 月担任 鹏华香港中小企业指数 (LOF)基金基金经理, 2016 年 10 月至 2018 年 04 月 担任鹏华互联 网分级基金经理, 2019 年 03 月担任 鹏华国防分级基金经理, 2019 年 07 月担任 鹏华国际分级基金经理, 2019 年 07 月担任 鹏华国际分级基金经理, 2019 年 07 月担任 鹏华正 黄分级基金基金经理, 2019 年 08 月担任 鹏华正 黄子分级基金基金经理, 2019 年 08 月担任 鹏华空天一体军工指数 (LOF)基金基			
2018 年 04 月 担任鹏华地产 分级基金基金 经理,2016 年 09 月至 2018 年 05 月担任 鹏华香港中小 企业指数 (LOF)基金基 金经理,2016 年 10 月至 2018 年 04 月 担任鹏华互联 网分级基金基 金经理,2019 年 03 月担任 鹏华国防分级 基金基金经 理,2019 年 03 月担任鹏华证 券分级基金基 金经理,2019 年 03 月担任			
担任縣华地产 分级基金基金 经理,2016年 09月至2018年05月担任 鹏华香港中小 企业指数 (LOF)基金基 金经理,2016年10月至 2018年04月 担任縣华互联 网分级基金基 金经理,2019年03月担任 鹏华国防分级基金基 全经理,2019年03月担任鹏华证 券分级基金基 金经理,2019年03月担任鹏华证 券分级基金基 金经理,2019年03月担任鹏华证 券分级基金基 金经理,2019年03月担任			
分级基金基金 经理,2016年 09月至2018年05月担任 鹏华香港中小 企业指数 (LOF)基金基 金经理,2016年10月至 2018年04月 担任鹏华互联 网分级基金基 金经理,2019年03月担任 鹏华国防分级 基金基金经 理,2019年0 月担任鹏华证 券分级基金基 金经理,2019年03月担任 鹏华区两个级基金基			
经理, 2016 年 09 月至 2018 年 05 月担任 鹏华香港中小企业指数 (LOF)基金基金经理, 2016 年 10 月至 2018 年 04 月 担任鹏华互联 网分级基金基金经理, 2019 年 03 月担任 鹏华国防分级基金基金经理, 2019 年 06 月担任鹏华证券分级基金基金经理, 2019 年 07 月担任鹏华证券分级基金基金经理, 2019 年 07 月担任 鹏华正天一体军工指数 (LOF)基金基			
09 月至 2018 年 05 月担任 鹏华香港中小 企业指数 (LOF)基金基 金经理, 2016 年 10 月至 2018 年 04 月 担任鹏华互联 网分级基金基 金经理, 2019 年 03 月担任 鹏华国防分级 基金基金经 理, 2019 年 03 月担任鹏华证 券分级基金基 金经理, 2019 年 03 月担任 鹏华正			经理,2016年
鹏华香港中小企业指数 (LOF)基金基金经理,2016年10月至2018年04月担任鹏华互联网分级基金基金经理,2019年03月担任鹏华国防分级基金基金经理,2019年05月担任鹏华证券分级基金基金经理,2019年05月担任鹏华证券分级基金基金经理,2019年103月担任鹏华还天一体军工指数(LOF)基金基			09 月至 2018
企业指数 (LOF)基金基金经理,2016年10月至2018年04月担任鹏华互联网分级基金基金经理,2019年03月担任鹏华国防分级基金基金经理,2019年05月担任鹏华证券分级基金基金经理,2019年05月担任鹏华证券分级基金基金经理,2019年03月担任鹏华还天一体军工指数(LOF)基金基			年 05 月担任
(LOF) 基金基金经理, 2016年10月至2018年04月担任鹏华互联网分级基金基金经理, 2019年03月担任鹏华国防分级基金基金经理, 2019年03月担任鹏华证券分级基金基金经理, 2019年03月担任鹏华证券分级基金基金经理, 2019年03月担任鹏华正大一体军工指数(LOF) 基金基金			鹏华香港中小
金经理,2016 年10月至 2018年04月 担任鹏华互联 网分级基金基 金经理,2019 年03月担任 鹏华国防分级 基金基金经 理,2019年05 月担任鹏华证 券分级基金基 金经理,2019 年03月担任 鹏华空天一体 军工指数 (LOF)基金基			企业指数
年 10 月至 2018 年 04 月 担任鹏华互联 网分级基金基 金经理, 2019 年 03 月担任 鹏华国防分级基金基金经 理, 2019 年 05 月担任鹏华证券分级基金基 金经理, 2019 年 03 月担任 鹏华空天一体 军工指数 (LOF)基金基			(LOF)基金基
2018年04月 担任鹏华互联 网分级基金基 金经理,2019年03月担任 鹏华国防分级 基金基金经 理,2019年03 月担任鹏华证 券分级基金基 金经理,2019年03月担任 鹏华空天一体 军工指数 (LOF)基金基			金经理,2016
担任鹏华互联 网分级基金基 金经理,2019年 03 月担任 鹏华国防分级 基金基金经 理,2019年 03 月担任 鹏华证 券分级基金基 金经理,2019年 03 月担任 鹏华空天一体 军工指数 (LOF)基金基			年 10 月至
网分级基金基金经理,2019年03月担任 鹏华国防分级基金基金经理,2019年03月担任鹏华证券分级基金基金经理,2019年03月担任鹏华证券分级基金基金经理,2019年03月担任 鹏华空天一体军工指数 (LOF)基金基			2018年04月
金经理,2019 年 03 月担任 鹏华国防分级 基金基金经 理,2019 年 03 月担任鹏华证 券分级基金基 金经理,2019 年 03 月担任 鹏华空天一体 军工指数 (LOF)基金基			担任鹏华互联
年 03 月担任 鹏华国防分级 基金基金经 理,2019 年 03 月担任鹏华证 券分级基金基 金经理,2019 年 03 月担任 鹏华空天一体 军工指数 (LOF)基金基			网分级基金基
鹏华国防分级 基金基金经 理,2019年03 月担任鹏华证 券分级基金基 金经理,2019 年03 月担任 鹏华空天一体 军工指数 (LOF)基金基			金经理,2019
基金基金经理,2019年05月担任鹏华证券分级基金基金经理,2019年05月担任鹏华证券分级基金基金经理,2019年03月担任鹏华空天一体军工指数(LOF)基金基			年 03 月担任
理,2019年03月担任鹏华证券分级基金基金经理,2019年03月担任鹏华正务分级基金基金经理,2019年03月担任鹏华空天一体军工指数(LOF)基金基			鹏华国防分级
月担任鹏华证			基金基金经
券分级基金基 金经理,2019 年 03 月担任 鹏华空天一体 军工指数 (LOF)基金基			理, 2019年 03
金经理,2019 年 03 月担任 鹏华空天一体 军工指数 (LOF)基金基			月担任鹏华证
年 03 月担任 鹏华空天一体 军工指数 (LOF)基金基			券分级基金基
鵬华空天一体 军工指数 (LOF)基金基			金经理,2019
军工指数 (LOF)基金基			年 03 月担任
(LOF)基金基			鹏华空天一体
金经理,2019			(LOF)基金基
			金经理,2019

		年 03 月担任
		鹏华证券保险
		分级基金基金
		经理,2019年
		11 月担任中证
		500 基金基金
		经理,2019年
		12 月担任龙头
		券商基金基金
		经理。陈龙先
		生具备基金从
		业资格。本报
		告期内本基金
		基金经理未发
		生变动。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

### 4.2 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 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金秉承指数基金的投资策略,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。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2019年4季度,A股震荡上行。报告期内上证指数上涨 4.99%,深证成指上涨 10.42%,本基金跟踪的中证国防指数上涨 1.53%。

本报告期内,组合净值增长率为 2.06%,业绩比较基准增长率为 1.48%,基金年化跟踪误差为 1.72%。

## 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

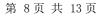
## 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6, 185, 491, 939. 95	94. 11
	其中: 股票	6, 185, 491, 939. 95	94. 11
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	380, 086, 956. 04	5. 78
8	其他资产	7, 018, 458. 91	0.11
9	合计	6, 572, 597, 354. 90	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	ļ	_
В	采矿业	ļ	_
С	制造业	6, 183, 258, 284. 26	94. 43
D	电力、热力、燃气及水生产和	_	_
D	供应业		
Е	建筑业	1	_
F	批发和零售业		_





G	交通运输、仓储和邮政业	_	-
Н	住宿和餐饮业	_	_
т	信息传输、软件和信息技术服		
1	务业		
Ј	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		_
0	居民服务、修理和其他服务业		_
Р	教育		_
Q	卫生和社会工作		_
R	文化、体育和娱乐业	_	_
S	综合	_	_
	合计	6, 183, 258, 284. 26	94. 43

## 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	_	_
В	采矿业	_	_
С	制造业	1, 473, 324. 06	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和		
D	供应业	_	_
Е	建筑业	_	_
F	批发和零售业	-	_
G	交通运输、仓储和邮政业	_	_
Н	住宿和餐饮业	-	_
Ι	信息传输、软件和信息技术服		
1	务业	753, 753. 59	0.01
Ј	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	6, 578. 04	-
0	居民服务、修理和其他服务业	_	-
Р	教育	_	-
Q	卫生和社会工作	_	_
R	文化、体育和娱乐业		_
S	综合	_	-
	合计	2, 233, 655. 69	0.03

# 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:无。

### 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 报告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

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	000066	中国长城	35, 624, 885	554, 323, 210. 60	8. 47
2	000768	中航飞机	28, 069, 942	459, 785, 649. 96	7. 02
3	002179	中航光电	10, 849, 917	423, 797, 758. 02	6. 47
4	002465	海格通信	37, 396, 100	404, 999, 763. 00	6. 19
5	600893	航发动力	18, 248, 125	395, 619, 350. 00	6. 04
6	600038	中直股份	5, 976, 462	285, 137, 002. 02	4. 35
7	600760	中航沈飞	8, 518, 779	269, 193, 416. 40	4. 11
8	600879	航天电子	44, 110, 974	263, 783, 624. 52	4. 03
9	600118	中国卫星	11, 988, 688	256, 198, 262. 56	3. 91
10	002013	中航机电	36, 586, 532	253, 910, 532. 08	3. 88

# 5.3.2 报告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

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	688002	睿创微纳	25, 672	951, 147. 60	0.01
2	688023	安恒信息	2, 728	334, 261. 84	0.01
3	688030	山石网科	7, 957	301, 570. 30	0.00
4	688181	八亿时空	4, 306	189, 377. 88	0.00
5	688078	龙软科技	2,811	117, 921. 45	0.00

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注: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注: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

注: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注: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



注: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

注:无。

### 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

注: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

注: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

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

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、或在报告编制目前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

#### 5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	443, 753. 06
2	应收证券清算款	4, 217, 501. 28
3	应收股利	_

4	应收利息	89, 371. 01
5	应收申购款	2, 267, 833. 56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7, 018, 458. 91

## 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:无。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

# 5.11.5.1 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注:无。

### 5.11.5.2 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

序号 股票代码	机番化剂	肌面力粉	流通受限部分的公	占基金资产净	流通受限情况
	放景代码	股票名称	允价值(元)	值比例 (%)	说明
1	688002	睿创微纳	951, 147. 60	0.01	锁定期股票
2	688023	安恒信息	334, 261. 84	0.01	锁定期股票
3	688030	山石网科	301, 570. 30	0.00	锁定期股票
4	688181	八亿时空	189, 377. 88	0.00	新股未上市
5	688078	龙软科技	117, 921. 45	0.00	锁定期股票

### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位: 份

项目	鹏华国防分级	鹏华国防 A	鹏华国防 B
报告期期初基金份额总额	6, 083, 692, 136. 69	1, 110, 018, 253. 00	1, 110, 018, 253. 00
报告期期间基金总申购份额	1, 137, 118, 240. 39		_
减:报告期期间基金总赎回份额	1, 027, 688, 135. 63	_	_
报告期期间基金拆分变动份额(份额减	190, 958, 393. 31	26, 433, 692. 00	26, 433, 692. 00
少以"-"填列)	100, 000, 000. 01	20, 100, 002. 00	20, 100, 002. 00
报告期期末基金份额总额	6, 384, 080, 634. 76	1, 136, 451, 945. 00	1, 136, 451, 945. 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

第 12 页 共 13 页



注:无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细注: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%的情况注: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)《鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金合同》;
- (二)《鹏华中证国防指数分级证券投资基金托管协议》;
- (三)《鹏华中证国防指数分级证券投资基金2019年第4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 2020年1月20日

