

# 鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资 基金

## 2020 年第 1 季度报告

2020 年 3 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 4 月 22 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 04 月 21 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 2020 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 鹏华证券分级                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 场内简称       | 券商指基                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 基金主代码      | 160633                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 基金合同生效日    | 2015 年 5 月 6 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 报告期末基金份额总额 | 836,774,840.88 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，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。本基金力争鹏华证券份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 |
| 业绩比较基准     | 中证全指证券公司指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 风险收益特征     | 本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表                                                                                                                                                                                                                                             |

|                 |                                                                                                                     |                                      |                                      |
|-----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
|                 | 现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。                                                                                     |                                      |                                      |
| 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                                                                                                        |                                      |                                      |
| 下属分级基金的基金简称     | 券商指基                                                                                                                | 券商 A 级                               | 券商 B 级                               |
| 下属分级基金的场内简称     | 券商指基                                                                                                                | 券商 A 级                               | 券商 B 级                               |
| 下属分级基金的交易代码     | 160633                                                                                                              | 150235                               | 150236                               |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 774,083,886.88 份                                                                                                    | 31,345,477.00 份                      | 31,345,477.00 份                      |
| 下属分级基金的风险收益特征   | 本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 | 鹏华证券 A 份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的特征。 | 鹏华证券 B 份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。 |

注：无。

### § 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（2020 年 1 月 1 日-2020 年 3 月 31 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 23,865,099.52                       |
| 2. 本期利润         | -78,754,891.51                      |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1081                             |
| 4. 期末基金资产净值     | 773,774,931.88                      |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.925                               |

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

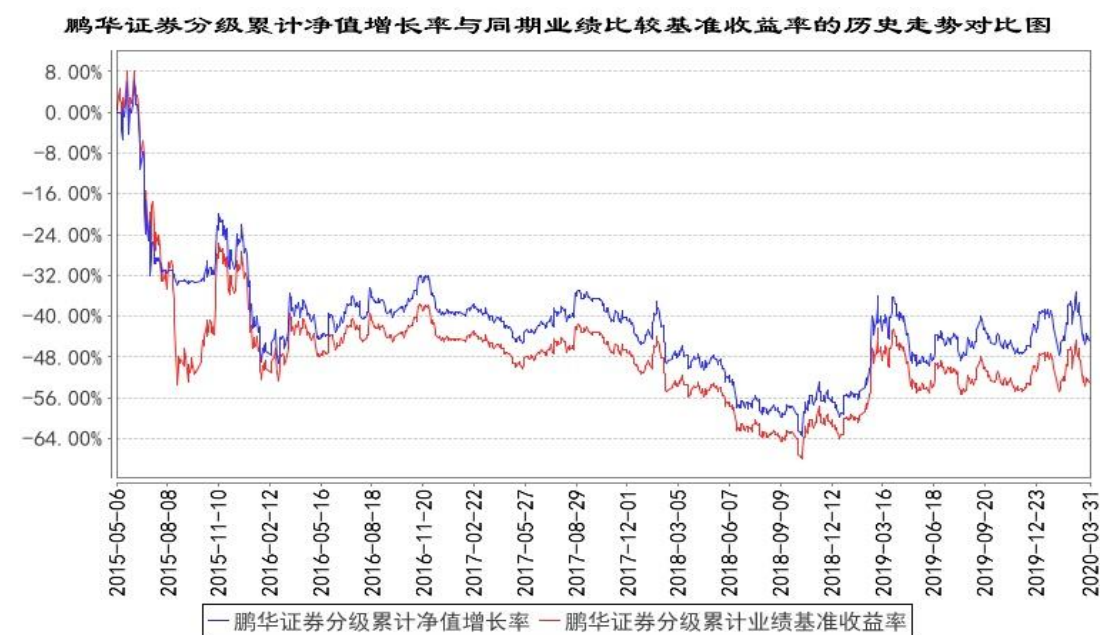
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | ①—③ | ②—④ |
|----|------------|---------------|----------------|----------------|-----|-----|
|----|------------|---------------|----------------|----------------|-----|-----|

|       |        |       |         | 准差④   |       |        |
|-------|--------|-------|---------|-------|-------|--------|
| 过去三个月 | -9.14% | 2.57% | -10.49% | 2.61% | 1.35% | -0.04% |

注：业绩比较基准=中证全指证券公司指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：1、本基金基金合同于 2015 年 05 月 06 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

| 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 |        |                                                                                                                                                             |
| 陈龙 | 本基金基金经理 | 2019-03-19  | -    | 11 年   | 陈龙先生，国籍中国，经济学硕士，11 年证券基金从业经验。曾任杭州衡泰软件公司金融工程师，2009 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部金融工程总监助理、量化及衍生品投资部量化研究总监助理，先后从事金融工程、量化研究等工作，现任量化及衍生品投资部量化研究副总监、基金经理。2015 年 09 月 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 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，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，2020 年 01 月担任鹏华中证 500ETF 联接基金基金经理。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

2020 年 1 季度，A 股呈现宽幅震荡下行。报告期内上证指数下跌 9.83%，深证成指下跌 4.49%，本基金跟踪的中证证券指数下跌 11.12%。

本报告期内，组合净值增长率为-9.14%，业绩比较基准增长率为-10.49%，基金年化跟踪误差为 1.59%。

#### 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              | 729,777,278.44 | 93.44        |
|    | 其中：股票             | 729,777,278.44 | 93.44        |
| 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      | 47,964,160.15  | 6.14         |
| 8  | 其他资产              | 3,290,303.15   | 0.42         |
| 9  | 合计                | 781,031,741.74 | 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              | 727,207,622.31 | 93.98 |
| 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               | 727,207,622.31 | 93.98 |

### 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              | -            | -            |
| C  | 制造业              | 1,895,791.96 | 0.25         |
| 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           | 19,147.31    | -            |
| 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  | 637,163.88   | 0.08         |
| 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       | 17,552.98    | -            |
| 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 | 2,569,656.13 | 0.33 |
|--|----|--------------|------|

### 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  | 600030 | 中信证券 | 5,106,943 | 113,169,856.88 | 14.63        |
| 2  | 600837 | 海通证券 | 4,851,245 | 62,289,985.80  | 8.05         |
| 3  | 300059 | 东方财富 | 3,220,800 | 51,693,840.00  | 6.68         |
| 4  | 601688 | 华泰证券 | 2,646,537 | 45,599,832.51  | 5.89         |
| 5  | 601211 | 国泰君安 | 2,703,468 | 44,012,459.04  | 5.69         |
| 6  | 600999 | 招商证券 | 1,714,262 | 29,348,165.44  | 3.79         |
| 7  | 000776 | 广发证券 | 1,774,307 | 24,272,519.76  | 3.14         |
| 8  | 000166 | 申万宏源 | 5,404,106 | 23,832,107.46  | 3.08         |
| 9  | 600958 | 东方证券 | 2,146,190 | 19,573,252.80  | 2.53         |
| 10 | 601901 | 方正证券 | 2,467,508 | 17,716,707.44  | 2.29         |

#### 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  | 688169 | 石头科技 | 3,857 | 1,137,082.17 | 0.15         |
| 2  | 688023 | 安恒信息 | 2,728 | 503,152.32   | 0.07         |
| 3  | 688189 | 南新制药 | 6,833 | 270,108.49   | 0.03         |
| 4  | 688085 | 三友医疗 | 8,807 | 184,594.72   | 0.02         |
| 5  | 688108 | 赛诺医疗 | 9,304 | 142,537.28   | 0.02         |

### 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**

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**

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**

广发证券

2019 年 3 月 25 日,广发证券收到广东证监局《关于对广发证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》(广东证监局行政监管措施决定书[2019]20 号),指出公司存在对境外子公司管控不到位,未有效督促境外子公司强化合规风险管理及审慎开展业务等问题,违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条、《证券公司和证券投资基金管理公司境外设立、收购、参股经营机构管理办法》第二十七条的规定;广东证监局依照《证券公司监督管理条例》第七十条的规定,决定对

公司采取责令改正的行政监管措施。对此，公司高度重视，将切实进行整改，采取措施建立并持续完善覆盖境外机构的合规管理、风险管理和内部控制体系。

2019 年 8 月 5 日，公司收到中国证券监督管理委员会《关于对广发证券股份有限公司采取限制业务活动措施的决定》（中国证券监督管理委员会行政监管措施决定书（2019）31 号），指出广发控股（香港）有限公司存在风险管控缺失、合规管理存在缺陷、内部管控不足及未做好广发控股香港月度数据统计工作等，对公司采取限制增加场外衍生品业务规模 6 个月、限制增加新业务种类 6 个月的行政监管措施。

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。

#### 招商证券

2019 年 9 月 11 日，中国证监会北京监管局向公司北京朝外大街证券营业部下发了《关于对招商证券股份有限公司北京朝外大街证券营业部采取责令改正并增加合规检查次数措施的决定》，认为该营业部在为某客户开立融资融券账户时，由于员工操作失误，该营业部将融资融券账户错误关联到另一客户股东账户下；在代销产品过程中，该营业部向某客户进行风险提示的留痕缺失。因此，北京证监局对该营业部作出责令改正并增加合规检查次数的监督管理措施决定。公司收到上述决定书后，高度重视，将严格按照监管要求进行整改并提交整改报告，并将按照监管要求对该营业部内部控制和合规风控管理开展合规检查。公司将持续采取优化系统流程、加强培训等措施，防止此类问题的再次发生。

2019 年 5 月 27 日，香港证券及期货事务监察委员会于其官方网站发布新闻稿，公司下属子公司招商证券（香港）有限公司（以下简称“招证香港”）因在担任中国金属再生资源（控股）有限公司香港联合交易所有限公司上市申请的联席保荐人时（2008 年 11 月至 2009 年 6 月）没有履行其应尽的尽职审查责任，香港证监会对招证香港采取谴责并处以罚款 2,700 万港元的纪律行动措施。公司及招证香港对香港证监会以上纪律行动措施决定无异议，且招证香港已采取整改措施，深化投行业务改革，强化勤勉、尽责、审慎、合规的原则，全面完善投行业务制度流程，提升投行业务内部控制水平，严控业务质量。

2019 年 5 月 30 日，香港证监会于其官方网站发布新闻稿，公司下属子公司招证香港在 2011 年 10 月 1 日至 2014 年 9 月 30 日期间因错误处理客户款项有关的监管违规事项及内部监控缺失，被香港证监会采取谴责并处以罚款 500 万港元的纪律行动措施。上述问题系因招证香港在程序及监控方面有所缺失，包括员工对于相关规则理解有偏差等所致，处理不当的客户款项均在日内转

回客户账户，未造成客户损失。招证香港已于 2015 年委聘一家独立检讨机构完成了独立的合规及监控检讨，并及时进行内部回顾检讨，切实加强内部监控，保障客户利益。

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。

#### 海通证券

2019 年 1 月 3 日，江苏证监局下发《关于对海通期货股份有限公司常州营业部采取责令改正措施的决定》（[2019]1 号），指出常州营业部在从业人员任职资格管理、投资者适当性等方面存在缺陷。海通期货对此高度重视，立即督促营业部积极进行整改，包括解散所涉投教延伸服务 QQ 群，加强员工职业行为规范教育，制定营业部期货服务群管理办法，告知投资者适当性测试结果并签署意见告知书等。

2019 年 5 月 7 日，上海证监局下发《关于对上海富诚海富通资产管理有限公司采取责令改正措施的决定》（沪证监决[2019]46 号），指出富诚海富通作为管理人，未对相关资产支持专项计划原始权益人与基础资产相关的业务情况及基础资产的现金流状况进行全面的尽职调查。整改措施：（1）富诚海富通对此高度重视，建立三级内部控制管理架构；（2）设立质量控制专岗，强化资产证券化业务质量控制；（3）强调尽职调查要求，全面提高项目尽职调查工作质量；（4）进一步完善产品评审机制；（5）强化内部管理工作，提高信息披露文件质量；（6）加强人才队伍建设；（7）排查存续项目风险状况，加强信用风险管理。

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。

#### 国泰君安

本基金持有的前十大证券之一的国泰君安证券股份有限公司在本报告期内有如下情形需要公告：

吉林证监局关于对国泰君安证券股份有限公司四平中央西路证券营业部采取责令改正行政监管措施的决定（20190920），具体如下：营业部员工王珏在替客户办理证券交易操作，与客户约定分享投资收益的行为，营业部未能有效防范员工违法违规风险，存在异常交易监控不到位，部分重要空白合同文本管理不到位的问题，反映公司营业部内控不完善。上述行为违反了《证券经纪人管理暂行规定》第十八条及《证券公司监督管理条例》第二十七条第一款的规定，根据规定，吉林证监局对营业部采取责令整改的行政监管措施。

深圳证监局关于对国泰君安证券股份有限公司深圳红荔西路证券营业部采取出局警示函措施的决定（20200317），具体如下：营业部存在副总经理实际履行分支机构负责人职责 4 个月未向深圳证监局报备，违反了《证券公司分支机构监管规定》第十七条相关规定，因此对营业部采取出局警示函的行政监管措施，要求营业部加强综合管理，提升合规管理水平，依法稳健经营。

中国证券监督管理委员会上海监管局关于对国泰君安证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定（20191219），具体如下：公司分支机构员工存在替客户办理证券交易操作、为客户的融资活动提供便利等违规行为，公司未能有效动态监控客户交易活动，未及时报告、处置重大异常行为，在分支机构管理、异常交易和操作监控等方面存在不足。上述行为违反了《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第 133 号）第六条第三项、《证券经纪人管理暂行规定》（证监会公告[2009]2 号）第十八条、《证券公司内部控制指引》（证监机构字[2003]260 号）第三十七条的有关规定。根据《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第三十二条第一款的规定，现决定对公司采取出具警示函的行政监管措施。

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 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   | 167,876.62   |
| 2  | 应收证券清算款 | —            |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | 11,261.49    |
| 5  | 应收申购款   | 3,111,165.04 |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 3,290,303.15 |

### 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   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 688169 | 石头科技 | 1,137,082.17   | 0.15         | 锁定期股票    |
| 2  | 688023 | 安恒信息 | 503,152.32     | 0.07         | 锁定期股票    |
| 3  | 688189 | 南新制药 | 270,108.49     | 0.03         | 锁定期股票    |
| 4  | 688085 | 三友医疗 | 184,594.72     | 0.02         | 新股未上市    |
| 5  | 688108 | 赛诺医疗 | 142,537.28     | 0.02         | 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                        | 券商指基           | 券商 A 级        | 券商 B 级        |
|---------------------------|----------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 784,673,780.56 | 31,343,907.00 | 31,343,907.00 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 776,667,203.46 | -             | -             |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 787,253,957.14 | -             | -             |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -3,140.00      | 1,570.00      | 1,570.00      |
| 报告期期末基金份额总额               | 774,083,886.88 | 31,345,477.00 | 31,345,477.00 |

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及定期折算、不定期折算变动的份额。

## §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

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

| 投资者类别                                                                                                                          | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                |                |                | 报告期末持有基金情况     |         |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------|
|                                                                                                                                | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额           | 申购份额           | 赎回份额           | 持有份额           | 份额占比(%) |
| 机构                                                                                                                             | 1              | 20200101~20200114       | 181,995,388.94 | 116,278,964.06 | 181,995,388.94 | 116,278,964.06 | 13.90   |
| 个人                                                                                                                             | -              | -                       | -              | -              | -              | -              | -       |
| 产品特有风险                                                                                                                         |                |                         |                |                |                |                |         |
| 基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。 |                |                         |                |                |                |                |         |

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额、指数分级基金合并份额和红利再投；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额和指数分级基金拆分份额。

### 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) 《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》；
- (二) 《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金托管协议》；
- (三) 《鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金 2020 年第 1 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 4 月 22 日