

鹏华中证酒指数分级证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 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

送出日期：2020 年 8 月 31 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 06 月 30 日止。

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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42

7.6 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	42
7.7 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	42
7.8 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	42
7.9 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	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	43
§ 8 基金份额持有人信息.....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末上市基金前十名持有人	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.4 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	46
§ 9 开放式基金份额变动.....	46
§ 10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
10.2 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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
11.1 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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证酒指数分级证券投资基金		
基金简称	鹏华酒分级		
场内简称	酒分级		
基金主代码	160632		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 4 月 29 日		
基金管理人	鹏华基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	503,759,404.86 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015 年 5 月 11 日		
下属分级基金的基金简称	鹏华酒分级	鹏华酒分级 A	鹏华酒分级 B
下属分级基金的场内简称	酒分级	酒 A	酒 B
下属分级基金的交易代码	160632	150229	150230
报告期末下属分级基金的份额总额	496,878,358.86 份	3,440,523.00 份	3,440,523.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来

	影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。 本基金力争鹏华酒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	中证酒指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	鹏华酒 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。		
	鹏华酒分级	鹏华酒分级 A	鹏华酒分级 B
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。	鹏华酒 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。	鹏华酒 B 份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的特征。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	李申
	联系电话	0755-82825720	021-60637102
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	021-60637111
传真		0755-82021126	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		何如	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	74,046,428.51
本期利润	132,618,064.75
加权平均基金份额本期利润	0.2901
本期加权平均净值利润率	23.98%
本期基金份额净值增长率	25.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	218,917,225.25
期末可供分配基金份额利润	0.4346
期末基金资产净值	758,937,033.79
期末基金份额净值	1.507
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	146.81%

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 6 月 30 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
过去一个月	12.13%	1.61%	10.89%	1.66%	1.24%	-0.05%

过去三个月	36.88%	1.40%	34.88%	1.43%	2.00%	-0.03%
过去六个月	25.27%	1.95%	20.59%	1.97%	4.68%	-0.02%
过去一年	38.31%	1.63%	29.55%	1.65%	8.76%	-0.02%
过去三年	120.97%	1.85%	99.65%	1.84%	21.32%	0.01%
自基金合同生效起至今	146.81%	1.93%	126.16%	1.90%	20.65%	0.03%

注：业绩比较基准=中证酒指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鹏华酒分级累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2015 年 04 月 29 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，注册资本 15,000 万元人民币。截至 2020 年 6 月，公司管理资产总规模达到 7,014.31 亿元，管理 196 只公募基金、12 只全国社保投资组合、4 只基本养老保险投资组合。经过 22 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		
闫冬	本基金基金经理	2019-03-19	-	10 年	闫冬先生，国籍中国，理学硕士，10 年证券基金从业经验。曾任招商期货有限公司资产管理部投资经理；2018 年 5 月加盟鹏华基金管理有限公司，现任量化及衍生品投资部基金经理。2019 年 03 月担任鹏华信息分级基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华环保分级基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华酒分级基金基金经理，2019 年 04 月担任鹏华地产分级基金基金经理，2019 年 11 月担任鹏华银行分级基金基金经理，2019 年 11 月担任鹏华资源分级基金基金经理。闫冬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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的

基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 25.27%，业绩比较基准增长率 20.59%。本报告期，基金年化跟踪误差 1.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在全球宽松的背景之下，股票、商品等市场的资产价格通胀压力持续。在疫情发展的当前阶段，中国凭借出色的防护措施、巨大的市场空间，使得整体经济表现韧性较强，叠加相对低估值，A 股或有望持续获得全球资金的关注。稳经济稳就业是当前宏观经济的重要选择，在全球贸易低迷不振的大环境下，内需相关板块或存在较好的投资机会，市场的结构性牛市或将持续。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1) 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及账务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银

行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

（2）特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4. 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同约定，在存续期内，本基金（包括鹏华酒分级份额、鹏华酒分级 A 份额、鹏华酒分级 B 份额）不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监

督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证酒指数分级证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	49,682,417.50	41,967,658.88
结算备付金		204,984.73	217,880.75
存出保证金		133,599.43	147,175.06
交易性金融资产	6.4.7.2	709,014,255.79	624,638,753.13
其中：股票投资		709,014,255.79	624,638,753.13
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		381,628.95	14,997,073.18
应收利息	6.4.7.5	12,046.13	9,123.24
应收股利		-	-
应收申购款		17,624,949.59	2,709,033.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		777,053,882.12	684,686,698.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		16,907,349.00	23,184,306.85
应付管理人报酬		533,783.92	552,768.11
应付托管费		117,432.45	121,609.00
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	330,361.68	185,956.09
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	227,921.28	304,950.55
负债合计		18,116,848.33	24,349,590.60
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	307,498,105.59	334,983,757.85
未分配利润	6.4.7.10	451,438,928.20	325,353,349.67
所有者权益合计		758,937,033.79	660,337,107.52
负债和所有者权益总计		777,053,882.12	684,686,698.12

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额总额 503,759,404.86 份，其中鹏华酒分级基金份额总额 496,878,358.86 份，基金份额净值 1.507 元；鹏华酒分级 A 基金份额总额 3,440,523.00 份，基金份额净值 1.026 元；鹏华酒分级 B 基金份额总额 3,440,523.00 份，基金份额净值 1.988 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证酒指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		137,360,276.59	241,967,212.99
1. 利息收入		147,705.72	128,709.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	147,705.72	128,709.71
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填		77,171,952.93	59,903,687.95

列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.12	71,212,123.74	53,835,216.84
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收 益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	5,959,829.19	6,068,471.11
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.17	58,571,636.24	180,409,273.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号 填列）	6.4.7.18	1,468,981.70	1,525,541.77
减：二、费用		4,742,211.84	4,434,890.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,771,208.53	2,519,715.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	609,665.79	554,337.46
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,134,332.53	1,123,794.10
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	227,004.99	237,042.52
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）		132,618,064.75	237,532,322.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		132,618,064.75	237,532,322.93

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华中证酒指数分级证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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）	334,983,757.85	325,353,349.67	660,337,107.52
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数（本期	-	132,618,064.75	132,618,064.75

利润)			
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)	-27,485,652.26	-6,532,486.22	-34,018,138.48
其中: 1. 基金申购款	456,192,981.03	470,687,843.61	926,880,824.64
2. 基金赎回款	-483,678,633.29	-477,220,329.83	-960,898,963.12
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)	307,498,105.59	451,438,928.20	758,937,033.79
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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)	359,840,919.95	26,064,776.93	385,905,696.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	237,532,322.93	237,532,322.93
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)	-28,979,118.63	-3,573,119.14	-32,552,237.77
其中: 1. 基金申购款	527,261,855.34	294,561,456.63	821,823,311.97
2. 基金赎回款	-556,240,973.97	-298,134,575.77	-854,375,549.74
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)	330,861,801.32	260,023,980.72	590,885,782.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华中证酒指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 503 号《关于准予鹏华中证酒指数分级证券投资基金注册的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证酒指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 665,650,412.73 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 399 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证酒指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 665,706,581.36 份基金份额,其中认购资金利息折合 56,168.63 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《鹏华中证酒指数分级证券投资基金基金合同》并报中国证监会备案,本基金的基金份额包括鹏华中证酒指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“鹏华酒份额”)、鹏华中证酒指数分级证券投资基金之 A 份额(以下简称“鹏华酒 A 份额”)、鹏华中证酒指数分级证券投资基金之 B 份额(以下简称“鹏华酒 B 份额”)。根据对基金财产及收益分配的不同安排,本基金的基金份额具有不同的风险收益特征。鹏华酒份额为可以申购、赎回但不能上市交易的基金份额,具有与标的指数相似的风险收益特征。鹏华酒 A 份额与鹏华酒 B 份额为可以上市交易但不能申购、赎回的基金份额,其中鹏华酒 A 份额为稳健收益类份额,具有低风险且预期收益相对较低的风险收益特征,鹏华酒 B 份额为积极收益类份额,具有高风险且预期收益相对较高的风险收益特征。鹏华酒 A 份额与鹏华酒 B 份额的配比始终保持 1:1 的比率不变。本基金的基金份额初始公开发售结束后,场外认购的全部份额将确认为鹏华酒份额;场内认购的份额将按照 1:1 的比例确认为鹏华酒 A 份额与鹏华酒 B 份额。本基金基金合同生效后,鹏华酒份额与鹏华酒 A 份额、鹏华酒 B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换,包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。基金份额的分拆,指基金份额持有人将其持有的鹏华酒份额按照 2 份场内鹏华酒份额对应 1 份鹏华酒 A 份额与 1 份鹏华酒 B 份额的比例进行转换的行为;基金份额的合并,指基金份额持有人将其持有的鹏华酒 A 份额与鹏华酒 B 份额按照 1 份鹏华酒 A 份额与 1 份鹏华酒 B 份额对应 2 份场内鹏华

酒份额的比例进行转换的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：鹏华酒份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为鹏华酒份额、鹏华酒 A 份额、鹏华酒 B 份额的份额数之和。鹏华酒 A 份额的基金份额净值为鹏华酒 A 份额的本金及约定应得收益之和。每 2 份鹏华酒份额所对应的基金资产净值等于 1 份鹏华酒 A 份额与 1 份鹏华酒 B 份额所对应的基金资产净值之和。

本基金定期进行份额折算。在鹏华酒 A 份额、鹏华酒份额存续期内的每个会计年度 12 月第一个工作日，本基金将进行基金的定期份额折算。在基金份额折算前与折算后，鹏华酒 A 份额与鹏华酒 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于鹏华酒 A 份额的约定应得收益，即鹏华酒 A 份额每个会计年度 11 月 30 日基金份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内鹏华酒份额分配给鹏华酒 A 份额持有人。鹏华酒份额持有人持有的每 2 份鹏华酒份额将按 1 份鹏华酒 A 份额获得新增鹏华酒份额的分配。持有场外鹏华酒份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外鹏华酒份额的分配；持有场内鹏华酒份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内鹏华酒份额的分配。经过上述份额折算，鹏华酒 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，鹏华酒份额的基金份额净值将相应调整。

除定期份额折算外，本基金还将在鹏华酒份额的基金份额净值达到 1.500 元时或鹏华酒 B 份额的基金份额参考净值跌至 0.250 元时进行不定期份额折算。当达到不定期折算条件时，本基金将分别对鹏华酒份额、鹏华酒 A 份额、鹏华酒 B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保鹏华酒 A 份额与鹏华酒 B 份额的比例为 1:1，份额折算后鹏华酒份额的基金份额净值、鹏华酒 A 份额与鹏华酒 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2015]第 180 号文审核同意，本基金鹏华酒 A 份额 211,143,563.00 份基金份额和鹏华酒 B 份额 211,143,564.00 份基金份额于 2015 年 5 月 11 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的鹏华酒份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为鹏华酒 A 份额和鹏华酒 B 份额即可上市流通；对于托管在场外的鹏华酒份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深交所场内后分拆为鹏华酒 A 份额和鹏华酒 B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证酒指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票）、债券、股指期货、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于股票部分的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交

易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证酒指数收益率 $\times 95\%$ + 商业银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

6.4.2 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〈年度报告和中期报告〉》、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》、《鹏华中证酒指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年上半年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 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	49,682,417.50
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	49,682,417.50
----	---------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	534,543,181.00	709,014,255.79	174,471,074.79
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	534,543,181.00	709,014,255.79	174,471,074.79

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	11,893.83
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	92.20
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	-
应收出借证券利息	-

其他	60.10
合计	12,046.13

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	330,361.68
银行间市场应付交易费用	—
合计	330,361.68

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	59,572.14
应付证券出借违约金	—
预提费用	118,349.14
应付指数使用费	50,000.00
合计	227,921.28

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	548,798,908.42	334,983,757.85
本期申购	747,344,086.66	456,192,981.03
本期赎回（以“-”号填列）	-792,383,590.22	-483,678,633.29
- 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	503,759,404.86	307,498,105.59

注：本基金的基金份额包括鹏华酒分级份额、鹏华酒分级 A 份额和鹏华酒分级 B 份额。本期申购含申购及转换入的鹏华酒分级份额和配对转入的鹏华酒分级 A 份额和鹏华酒分级 B 份额，本期赎回含赎回及转换出的鹏华酒分级份额和配对转出的鹏华酒分级 A 份额和鹏华酒分级 B 份额。

6.4.7.10 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	149,544,349.33	175,809,000.34	325,353,349.67
本期利润	74,046,428.51	58,571,636.24	132,618,064.75
本期基金份额交易产生的变动数	-4,673,552.59	-1,858,933.63	-6,532,486.22
其中：基金申购款	268,370,284.48	202,317,559.13	470,687,843.61
基金赎回款	-273,043,837.07	-204,176,492.76	-477,220,329.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	218,917,225.25	232,521,702.95	451,438,928.20

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	143,444.97
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	2,425.08
其他	1,835.67
合计	147,705.72

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	71,212,123.74
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	71,212,123.74

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	384,556,625.78
减：卖出股票成本总额	313,344,502.04
买卖股票差价收入	71,212,123.74

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,959,829.19
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	5,959,829.19

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	58,571,636.24
股票投资	58,571,636.24
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	58,571,636.24

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,431,267.79
基金转换费收入	37,713.91
合计	1,468,981.70

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,134,332.53
银行间市场交易费用	—
合计	1,134,332.53

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	28,841.54
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	—
银行汇划费用	8,655.85
指数使用费	100,000.00
上市年费	29,835.26
合计	227,004.99

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《鹏华中证酒指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定和《鹏华中证酒指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告》，本基金的基金管理人确定 2020 年 7 月 1 日为份额折算基准日，对鹏华中证酒指数分级证券投资基金实施不定期份额折算。折算前，鹏华酒分级场外份额和场内份额分别为 479,792,236.20 份和 6,402,127.00 份，根据基金份额折算公式，新增份额折算比例为 0.583373147，折算后鹏华酒分级场外份额总额和场内份额总额分别为 759,690,142.93 份和 10,136,955.00 份，鹏华酒分级份额净值为 1.000 元；折算前，鹏华酒 A 份额份额总额为 3,440,523.00 份，根据基金份额折算公式，新增份额折算比例为 0.026311475，折算后鹏华酒 A 份额份额总额为 3,440,523.00 份，新增鹏华酒分级场内份额 90,525.00 份，份额净值为 1.000 元；折算前，鹏华酒 B 份额份额总额为 3,440,523.00 份，根据基金份额折算公式，新增份额折算比例为 1.140434820，折算后鹏华酒 B 份额份额总额为 3,440,523.00 份，新增鹏华酒分级场内份额 3,923,692.00 份，份额净值为 1.000 元。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述折算比例，对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了折算，并于 2020 年 7 月 2 日进行了变

更登记。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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	73,333,268.71	10.39	155,690,519.36	20.93

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30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	66,828.89	10.55	28,731.12	8.70
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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	141,881.07	21.35	111,217.41	23.26

注：（1）佣金的计算公式

上海/深圳证券交易所的交易佣金=股票买（卖）成交金额×佣金比率-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约定的佣金比例签订了《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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,771,208.53	2,519,715.98
其中：支付销售机构的客户维护费	1,164,631.10	1,067,014.76

注：1、支付基金管理人鹏华基金管理公司的管理人报酬年费率为1.00%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.00%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	609,665.79	554,337.46

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费年费率为 0.22%，逐日计提，按月支付。日托管费＝前一日基金资产净值×0.22%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
-------	--	--

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	49,682,417.50	143,444.97	51,098,465.51	122,777.65

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在报告期内未参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末(2020年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
601816	京沪高铁	2020年1月8日	2020年7月16日	锁定期股票	4.88	6.17	906,536	4,423,895.68	5,593,327.12	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688177	百奥泰-U	2020年2月13日	2020年8月21日	锁定期股票	32.76	57.02	18,488	605,666.88	1,054,185.76	-
688228	开普	2020	2020	锁定期	59.26	73.20	2,718	161,068.68	198,957.60	-

	云	年 3 月 19 日	年 9 月 28 日	股票						
688277	天智航-U	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 7 日	新股未 上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688377	迪威尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	新股未 上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688528	秦川物联	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 1 日	新股未 上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688568	中科星图	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未 上市	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688600	皖仪科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 3 日	新股未 上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起约定限售期内不得转让。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 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同责任，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建设银行股份有限公司，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 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2019 年 12 月 31 日：未持有）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 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、组合在短时间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均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，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。

于 2020 年 6 月 30 日，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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 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时间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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	49,682,417.50	-	-	-	49,682,417.50
结算备付金	204,984.73	-	-	-	204,984.73
存出保证金	133,599.43	-	-	-	133,599.43
交易性金融资产	-	-	-	709,014,255.79	709,014,255.79
应收利息	-	-	-	12,046.13	12,046.13
应收申购款	-	-	-	17,624,949.59	17,624,949.59
应收证券清算款	-	-	-	381,628.95	381,628.95
资产总计	50,021,001.66	-	-	727,032,880.46	777,053,882.12
负债					
应付赎回款	-	-	-	16,907,349.00	16,907,349.00
应付管理人报酬	-	-	-	533,783.92	533,783.92
应付托管费	-	-	-	117,432.45	117,432.45
应付交易费用	-	-	-	330,361.68	330,361.68
其他负债	-	-	-	227,921.28	227,921.28
负债总计	-	-	-	18,116,848.33	18,116,848.33

利率敏感度缺口	50,021,001.66	-	-	-708,916,032.13	758,937,033.79
上年度末 2019 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	41,967,658.88	-	-	-	41,967,658.88
结算备付金	217,880.75	-	-	-	217,880.75
存出保证金	147,175.06	-	-	-	147,175.06
交易性金融资产	-	-	-	-624,638,753.13	624,638,753.13
应收利息	-	-	-	9,123.24	9,123.24
应收申购款	-	-	-	2,709,033.88	2,709,033.88
应收证券清算款	-	-	-	14,997,073.18	14,997,073.18
资产总计	42,332,714.69	-	-	-642,353,983.43	684,686,698.12
负债					
应付赎回款	-	-	-	23,184,306.85	23,184,306.85
应付管理人报酬	-	-	-	552,768.11	552,768.11
应付托管费	-	-	-	121,609.00	121,609.00
应付交易费用	-	-	-	185,956.09	185,956.09
其他负债	-	-	-	304,950.55	304,950.55
负债总计	-	-	-	24,349,590.60	24,349,590.60
利率敏感度缺口	42,332,714.69	-	-	-618,004,392.83	660,337,107.52

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%

（2019 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（2019 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 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分券和备选成分券，所面临的其他价格风险来源于标的指数成分券和备选成分券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分券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。

本基金投资于股票部分的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。

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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	709,014,255.79	93.42	624,638,753.13	94.59
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	709,014,255.79	93.42	624,638,753.13	94.59
----	----------------	-------	----------------	-------

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	35,576,063.90	31,241,113.16
	业绩比较基准下降5%	-35,576,063.90	-31,241,113.16

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	709,014,255.79	91.24
	其中：股票	709,014,255.79	91.24
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	49,887,402.23	6.42
8	其他各项资产	18,152,224.10	2.34

9	合计	777,053,882.12	100.00
---	----	----------------	--------

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	694,588,686.59	91.52
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	6,491,016.00	0.86
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	-	-
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	701,079,702.59	92.38

7.2.2 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	1,938,770.39	0.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	5,593,327.12	0.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	389,689.37	0.05
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,934,553.20	1.05

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 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

7.3.1 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	000858	五 粮 液	408,319	69,871,547.28	9.21
2	600519	贵州茅台	46,618	68,196,539.84	8.99
3	000568	泸州老窖	690,161	62,887,470.32	8.29
4	002304	洋河股份	588,175	61,840,719.50	8.15
5	600809	山西汾酒	418,888	60,738,760.00	8.00
6	000860	顺鑫农业	831,900	47,401,662.00	6.25
7	600600	青岛啤酒	557,480	42,647,220.00	5.62
8	603369	今世缘	1,004,957	39,987,239.03	5.27
9	603589	口子窖	576,720	29,355,048.00	3.87
10	600132	重庆啤酒	387,659	28,299,107.00	3.73
11	000799	酒鬼酒	364,400	27,880,244.00	3.67
12	000596	古井贡酒	184,346	27,696,143.04	3.65
13	600779	水井坊	313,046	19,540,331.32	2.57
14	002568	百润股份	416,364	18,869,616.48	2.49
15	000729	燕京啤酒	2,257,920	15,466,752.00	2.04

16	600702	舍得酒业	377,552	14,101,567.20	1.86
17	600559	老白干酒	1,006,294	13,031,507.30	1.72
18	603198	迎驾贡酒	384,469	8,369,890.13	1.10
19	000869	张裕A	217,931	7,442,343.65	0.98
20	600059	古越龙山	777,225	7,243,737.00	0.95
21	600197	伊力特	347,900	6,877,983.00	0.91
22	300755	华致酒行	200,340	6,491,016.00	0.86
23	002461	珠江啤酒	531,900	5,329,638.00	0.70
24	603919	金徽酒	243,750	4,238,812.50	0.56
25	600199	金种子酒	632,300	4,122,596.00	0.54
26	002646	青青稞酒	288,400	3,152,212.00	0.42

7.3.2 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	601816	京沪高铁	906,536	5,593,327.12	0.74
2	688177	百奥泰-U	18,488	1,054,185.76	0.14
3	688228	开普云	2,718	198,957.60	0.03
4	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.02
5	300832	新产业	882	151,871.58	0.02
6	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.02
7	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.01
8	688277	天智航-U	8,810	106,072.40	0.01
9	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.01
10	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.01
11	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.01
12	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
13	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
14	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
15	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
16	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
17	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
18	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
19	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
20	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
21	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	002304	洋河股份	32,699,818.57	4.95

2	000568	泸州老窖	32,241,828.15	4.88
3	000858	五 粮 液	31,864,355.92	4.83
4	600519	贵州茅台	30,178,865.40	4.57
5	600809	山西汾酒	25,042,936.64	3.79
6	000860	顺鑫农业	23,883,984.05	3.62
7	603369	今世缘	22,593,684.19	3.42
8	600600	青岛啤酒	16,491,937.70	2.50
9	603589	口子窖	14,224,054.04	2.15
10	000596	古井贡酒	13,315,158.82	2.02
11	600132	重庆啤酒	10,823,680.44	1.64
12	600779	水井坊	8,397,402.34	1.27
13	000799	酒鬼酒	8,333,816.03	1.26
14	002568	百润股份	7,825,776.44	1.19
15	000729	燕京啤酒	7,606,977.00	1.15
16	601816	京沪高铁	6,319,848.88	0.96
17	600702	舍得酒业	5,668,839.12	0.86
18	600559	老白干酒	5,315,184.70	0.80
19	603198	迎驾贡酒	3,853,830.36	0.58
20	600059	古越龙山	3,522,805.99	0.53

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。

7.4.2 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	000858	五 粮 液	36,565,976.77	5.54
2	600519	贵州茅台	34,293,085.45	5.19
3	000568	泸州老窖	33,696,216.76	5.10
4	002304	洋河股份	33,372,493.46	5.05
5	000860	顺鑫农业	26,566,894.00	4.02
6	600809	山西汾酒	25,198,283.00	3.82
7	600600	青岛啤酒	17,306,817.20	2.62
8	603589	口子窖	16,528,411.77	2.50
9	603369	今世缘	16,102,422.21	2.44
10	000596	古井贡酒	15,027,458.17	2.28
11	600132	重庆啤酒	11,811,131.87	1.79
12	600779	水井坊	9,215,943.05	1.40
13	000729	燕京啤酒	8,590,111.35	1.30
14	000799	酒鬼酒	8,192,755.27	1.24
15	002568	百润股份	7,924,921.29	1.20
16	600702	舍得酒业	6,243,700.00	0.95
17	600559	老白干酒	6,051,443.52	0.92
18	688012	中微公司	4,565,550.09	0.69

19	603198	迎驾贡酒	4,228,126.07	0.64
20	600059	古越龙山	3,908,465.90	0.59

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。

7.4.3 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	339,148,368.46
卖出股票收入（成交）总额	384,556,625.78

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.12.2 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。

7.12.3 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	133,599.43
2	应收证券清算款	381,628.95
3	应收股利	—
4	应收利息	12,046.13
5	应收申购款	17,624,949.59
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	18,152,224.10

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601816	京沪高铁	5,593,327.12	0.74	锁定期股票
2	688177	百奥泰-U	1,054,185.76	0.14	锁定期股票
3	688228	开普云	198,957.60	0.03	锁定期股票
4	688568	中科星图	178,634.20	0.02	新股未上市

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
鹏华酒分级	206,682	2,404.07	54,793.50	0.01	496,823,565.36	99.99
鹏华酒分级A	129	26,670.72	1,870,927.00	54.38	1,569,596.00	45.62
鹏华酒分级B	791	4,349.59	59,129.00	1.72	3,381,394.00	98.28
合计	207,602	2,426.56	1,984,849.50	0.39	501,774,555.36	99.61

8.2 期末上市基金前十名持有人

鹏华酒分级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	程社鑫	303,477.00	4.74
2	李贺	259,921.00	4.06
3	闵俊	236,388.00	3.69
4	袁昊	230,528.00	3.60
5	奕纪樑	210,600.00	3.29
6	江源	180,226.00	2.82
7	丁碧霞	173,966.00	2.72
8	李桂芳	145,869.00	2.28

9	张中平	138,446.00	2.16
10	张曙迅	134,669.00	2.10

鹏华酒分级 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品-013C-CT001 深	936,375.00	27.22
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	397,866.00	11.56
3	陈龙	300,000.00	8.72
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	261,705.00	7.61
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—团体分红	231,794.00	6.74
6	汪愈建	145,555.00	4.23
7	谈璿	125,261.00	3.64
8	谭梅	121,474.00	3.53
9	王荣	101,607.00	2.95
10	周伟	89,075.00	2.59

鹏华酒分级 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	王红英	312,929.00	9.10
2	张玉军	226,900.00	6.59
3	周辉	184,022.00	5.35
4	包彦凯	157,100.00	4.57
5	董世珍	144,695.00	4.21
6	肖德勇	112,400.00	3.27
7	程社鑫	91,845.00	2.67
8	周彦华	84,363.00	2.45
9	金维岗	68,100.00	1.98
10	钱中明	67,300.00	1.96

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏华酒分级	53,800.62	0.0108
	鹏华酒分级 A	—	—
	鹏华酒分级 B	—	—

金			
	合计	53,800.62	0.0107

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。

8.4 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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华酒分级	鹏华酒分级 A	鹏华酒分级 B
基金合同生效日（2015 年 4 月 29 日）基金份额总额	243,419,454.36	211,143,563.00	211,143,564.00
本报告期期初基金份额总额	540,278,642.42	4,260,133.00	4,260,133.00
本报告期基金总申购份额	747,344,086.66	—	—
减：本报告期基金总赎回份额	792,383,590.22	—	—
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	1,639,220.00	-819,610.00	-819,610.00
本报告期期末基金份额总额	496,878,358.86	3,440,523.00	3,440,523.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

无

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
国泰君安	2	97,855,609.73	13.87%	89,176.60	14.08%	-
光大证券	1	94,088,007.51	13.34%	85,737.68	13.53%	-
方正证券	2	88,161,061.53	12.49%	80,340.55	12.68%	-
国信证券	2	73,333,268.71	10.39%	66,828.89	10.55%	-
中信证券	2	72,253,841.61	10.24%	58,620.09	9.25%	-
广发证券	1	64,263,894.11	9.11%	58,566.06	9.24%	-
长江证券	1	58,930,510.22	8.35%	53,702.28	8.48%	-
中泰证券	2	48,090,250.53	6.82%	43,824.90	6.92%	-
兴业证券	1	29,381,250.85	4.16%	26,775.40	4.23%	-
华融证券	1	22,547,616.03	3.20%	18,292.91	2.89%	-
中信建投	2	21,618,617.42	3.06%	19,700.64	3.11%	-
华西证券	1	17,196,197.96	2.44%	15,670.99	2.47%	-
中航证券	2	8,991,164.00	1.27%	8,193.82	1.29%	-

国金证券	1	6,717,178.51	0.95%	6,121.37	0.97%	-
天风证券	1	2,143,084.44	0.30%	1,953.09	0.31%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：无。

10.8 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青岛意才基金销售有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 01 月 17 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 01 月 17 日
3	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	《上海证券报》	2020 年 01 月 20 日
4	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	《中国证券报》	2020 年 01 月 20 日
5	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《证券时报》	2020 年 02 月 03 日
6	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《上海证券报》	2020 年 02 月 03 日

7	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《证券日报》	2020 年 02 月 03 日
8	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《证券日报》	2020 年 02 月 05 日
9	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《上海证券报》	2020 年 02 月 05 日
10	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《中国证券报》	2020 年 02 月 05 日
11	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《证券时报》	2020 年 02 月 05 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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》	2020 年 03 月 17 日
13	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《中国证券报》	2020 年 03 月 28 日
14	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《证券时报》	2020 年 03 月 28 日
15	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《证券日报》	2020 年 03 月 28 日
16	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《上海证券报》	2020 年 03 月 28 日
17	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在网上直销渠道开展申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 04 月 07 日
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在网上直销渠道开展申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 04 月 07 日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在网上直销渠道开展申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 07 日
20	鹏华中证酒指数分级证券投资基金更新的招募说明书摘要	《上海证券报》	2020 年 04 月 15 日
21	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》	2020 年 04 月 15 日

22	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《中国证券报》	2020 年 04 月 18 日
23	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《证券日报》	2020 年 04 月 18 日
24	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《证券时报》	2020 年 04 月 18 日
25	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年年度报告提示性公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 18 日
26	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《证券时报》	2020 年 04 月 22 日
27	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《中国证券报》	2020 年 04 月 22 日
28	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《证券日报》	2020 年 04 月 22 日
29	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 22 日
30	鹏华基金管理有限公司关于结束旗下 基金在中信证券华南股份有限公司 (原广州证券股份有限公司) 申购费 率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 28 日
31	鹏华基金管理有限公司关于结束旗下 基金在中信证券华南股份有限公司 (原广州证券股份有限公司) 申购费 率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 04 月 28 日
32	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与华安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	《证券日报》	2020 年 05 月 06 日
33	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与华安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	《上海证券报》	2020 年 05 月 06 日
34	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与华安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》	2020 年 05 月 06 日
35	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与华安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	《中国证券报》	2020 年 05 月 06 日
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分 基金参与万联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	《上海证券报》	2020 年 05 月 18 日

37	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联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》	2020 年 05 月 18 日
38	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联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	《中国证券报》	2020 年 05 月 18 日
39	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联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	《证券日报》	2020 年 05 月 18 日
40	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在蒙商银行股份有限公司暂停办理相关销售业务的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2020 年 05 月 23 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	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2020 年 06 月 03 日
42	鹏华中证酒指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告	《上海证券报》	2020 年 06 月 08 日
43	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在网上直销渠道开展申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 06 月 15 日
44	鹏华中证酒指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告	《上海证券报》	2020 年 06 月 15 日
45	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在网上直销渠道开展申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 06 月 15 日
46	鹏华中证酒指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告	《上海证券报》	2020 年 06 月 23 日
47	鹏华中证酒指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告	《上海证券报》	2020 年 06 月 30 日
48	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金招募说明书的补充提示	《上海证券报》	2020 年 01 月 16 日
49	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 01 月 17 日
50	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	《证券时报》	2020 年 01 月 20 日

注：无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证酒指数分级证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华中证酒指数分级证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华中证酒指数分级证券投资基金 2020 年中期报告》（原文）。

12.2 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。

12.3 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 8 月 31 日