
鹏华国证证券龙头交易型开放式指数证券 投资基金 2020 年第 4 季度报告

2020 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：中信证券股份有限公司

报告送出日期：2021 年 1 月 22 日

§ 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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 01 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 10 月 01 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	龙头券商
场内简称	龙头券商
基金主代码	159993
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 26 日
报告期末基金份额总额	1,274,697,982.00 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的最小化。
投资策略	<p>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。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年跟踪误差控制在 2% 以内。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> <p>1、股票投资策略（1）股票投资组合的构建 本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素</p>

时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。（2）股票投资组合的调整 本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，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，对其进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。1）定期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。2）不定期调整 根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整；根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金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。（3）存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。2、债券投资策略 本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。3、股指期货投资策略 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，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将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仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。4、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。5、融资及转融通投资策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。

业绩比较基准	国证证券龙头指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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。同时本基金为交易型开放式指数基金，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	中信证券股份有限公司

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（2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	45,467,552.71
2. 本期利润	46,829,300.12
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0403
4. 期末基金资产净值	1,572,136,630.38
5. 期末基金份额净值	1.2333

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。

3.2 基金净值表现

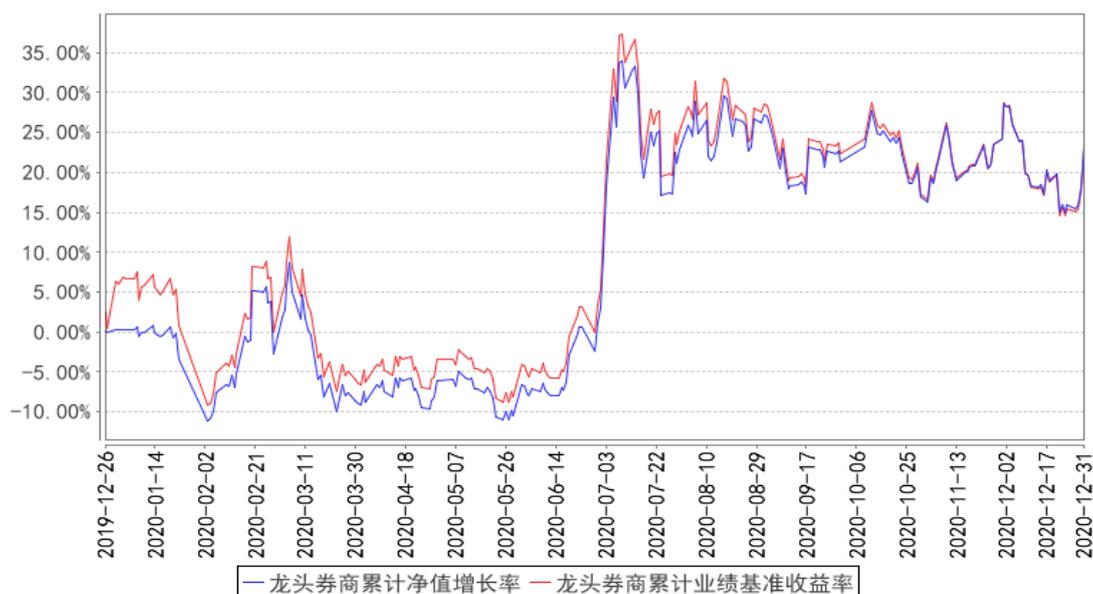
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	1.62%	1.71%	0.58%	1.75%	1.04%	-0.04%
过去六个月	22.01%	2.39%	18.85%	2.43%	3.16%	-0.04%
过去一年	23.01%	2.22%	16.07%	2.32%	6.94%	-0.10%
自基金合同 生效起至今	23.33%	2.20%	22.99%	2.34%	0.34%	-0.14%

注：业绩比较基准=国证证券龙头指数收益率

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

龙头券商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 2019 年 12 月 26 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	2019-12-26	-	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经理、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 月至 2020 年 12 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 月至 2020 年 12 月担任鹏华证券保险分级基金基金经理，2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华国防分级基金基金经理，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。

4.1.1 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 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 4 季度，A 股呈现震荡上行的格局，11 月份以来，随着外围事件的落地，市场呈现趋势性上升的行情。报告期内上证指数上涨 7.92%，深证成指上涨 12.11%，本基金跟踪的证券龙头指数上涨 0.58%。

本报告期内，本基金净值增长率为 1.62%，业绩比较基准增长率为 0.58%，基金年化跟踪误差为 0.88%。

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	1,539,328,578.60	96.20
	其中：股票	1,539,328,578.60	96.20
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	44,374,450.15	2.77
8	其他资产	16,511,514.66	1.03
9	合计	1,600,214,543.41	100.00

注：1、报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为 7,666,378.72 元，占净值比 0.49%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证；

2、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 5.2.1 的合计项不含可退替代款估值增值。

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	1,524,163,023.55	96.95
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,524,163,023.55	96.95

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	11,549,138.76	0.73
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	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	19,998.88	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,499,329.49	0.10
J	金融业	1,714,383.21	0.11
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	253,362.56	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	62,972.16	0.00
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	48,261.27	0.00
S	综合	-	-
	合计	15,163,769.05	0.96

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	300059	东方财富	7,413,668	229,823,708.00	14.62
2	600030	中信证券	7,664,115	225,324,981.00	14.33
3	600837	海通证券	8,646,200	111,190,132.00	7.07
4	601688	华泰证券	6,049,418	108,950,018.18	6.93
5	601211	国泰君安	4,979,159	87,284,657.27	5.55
6	600999	招商证券	3,538,460	82,587,656.40	5.25
7	600958	东方证券	4,520,325	52,571,379.75	3.34
8	000166	申万宏源	9,930,749	52,434,354.72	3.34
9	000776	广发证券	3,203,156	52,147,379.68	3.32
10	601901	方正证券	4,752,445	49,282,854.65	3.13

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	689009	九号公司-UWD	109,928	7,666,378.72	0.49
2	688180	君实生物-U	23,035	1,814,006.25	0.12
3	601995	中金公司	24,951	1,714,383.21	0.11
4	688536	思瑞浦	3,566	1,421,657.22	0.09
5	300999	金龙鱼	7,253	640,367.37	0.04

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，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将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仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而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

关于公司及相关人员收到中国证券监督管理委员会广东监管局《行政监管措施决定书》的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

2020 年 7 月 10 日，广发证券股份有限公司（以下简称“公司”）及相关人员分别收到中国证券监督管理委员会广东监管局（以下简称“广东证监局”）《行政监管措施事先告知书》（详见公司 2020-051 号公告）。2020 年 7 月 20 日，公司及相关人员分别收到广东证监局《行政监管措施决定书》，现将相关情况公告如下：

一、公司收到《行政监管措施决定书》的情况

2020 年 7 月 20 日，公司收到广东证监局《关于对广发证券股份有限公司采取责令改正、限制业务活动、责令限制高级管理人员权利监管措施的决定》（中国证券监督管理委员会广东监管局行政监管措施决定书（2020）97 号），原文如下：

广发证券股份有限公司：经查，你公司在康美药业股份有限公司 2014 年非公开发行优先股项目、2015 年公司债券项目、2016 年非公开发行股票项目、2018 年公司债券项目、康美实业投资控股有限公司 2017 年可交换公司债券项目中未勤勉尽责，尽职调查环节基本程序缺失，缺乏应有的执业审慎，内部控制流于形式，未按规定履行持续督导与受托管理义务。

上述行为违反了《证券发行上市保荐业务管理办法》（证监会令第 58 号，根据证监会令第 63 号修改，以下简称《保荐管理办法》）第四条、第二十四条、第三十五条，《公司债券发行与交易管理办法》（以下简称《债券管理办法》）第七条、第四十九条、第五十条、第五十二条的规定。按照《证券公司监督管理条例》第七十条，《保荐管理办法》第六十六条、第六十七条，《债券管理办法》第五十八条、第六十三条的规定，我局决定对你公司采取以下监管措施：

一、责令改正。你公司应对投行业务进行深入整改，建立健全和严格执行投行业务内控制度、工作流程和操作规范，诚实守信、勤勉尽责，切实提升投资银行业务质量。你公司应严格按照内部问责制度对责任人员进行内部问责，并向我局提交书面问责报告。

二、2020 年 7 月 20 日至 2021 年 1 月 19 日期间，暂停你公司保荐机构资格；在 2020 年 7 月 20 日至 2021 年 7 月 19 日期间，暂不受理你公司债券承销业务有关文件。

三、责令限制高级管理人员权利，限制时任分管相关投行业务的副总经理欧阳西领取 2014

年度、2015 年度、2016 年度基本工资以外薪酬的权利，限制时任分管相关投行业务的副总经理秦力领取 2017 年度、2018 年度基本工资以外薪酬的权利，已领取部分应全部退回公司。

如果对本监管措施不服，可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监管措施不停止执行。

二、公司及相关人员收到《行政监管措施决定书》的情况

1、公司及陈家茂收到《行政监管措施决定书》的情况

2020 年 7 月 20 日，公司及陈家茂收到广东证监局《关于对陈家茂采取认定为不适当人选监管措施的决定》(中国证券监督管理委员会广东监管局行政监管措施决定书(2020)98 号)，主要内容如下：

按照《保荐管理办法》第六十六条的规定，我局决定：

认定陈家茂为不适当人选，自监管措施决定作出之日起 10 年内不得担任证券公司证券发行上市保荐业务相关职务或者实际履行上述职务。广发证券股份有限公司应当在收到认定为不适当人选决定书之日起 30 个工作日内，作出免除陈家茂相关职务的决定，并在作出决定之日起 3 个工作日内向我局书面报告。

2、公司及林焕伟收到《行政监管措施决定书》的情况

2020 年 7 月 20 日，公司及林焕伟收到广东证监局《关于对林焕伟采取认定为不适当人选监管措施的决定》(中国证券监督管理委员会广东监管局行政监管措施决定书(2020)99 号)，主要内容如下：

按照《保荐管理办法》第六十六条的规定，我局决定：

认定林焕伟为不适当人选，自监管措施决定作出之日起 15 年内不得担任证券公司证券发行上市保荐业务相关职务或者实际履行上述职务，10 年内不得担任证券公司债券承销业务相关职务或者实际履行上职务。广发证券股份有限公司应当在收到认定为不适当人选决定书之日起 30 个工作日内，作出免除林焕伟相关职务的决定，并在作出决定之日起 3 个工作日内向我局书面报告。

3、公司及朱保力收到《行政监管措施决定书》的情况

2020 年 7 月 20 日，公司及朱保力收到广东证监局《关于对朱保力采取认定为不适当人选监管措施的决定》(中国证券监督管理委员会广东监管局行政监管措施决定书(2020)100 号)，主要内容如下：

按照《保荐管理办法》第六十六条的规定，我局决定：

认定朱保力为不适当人选，自监管措施决定作出之日起 15 年内不得担任证券公司证券发行上市保荐业务相关职务或者实际履行上述职务。广发证券股份有限公司应当在收到认定为不适当人选决定书之日起 30 个工作日内，作出免除朱保力相关职务的决定，并在作出决定之日起 3 个工作日内向我局书面报告。

4、公司及肖晋收到《行政监管措施决定书》的情况

2020 年 7 月 20 日，公司及肖晋收到广东证监局《关于对肖晋采取认定为不适当人选监管措施的决定》（中国证券监督管理委员会广东监管局行政监管措施决定书（2020）101 号），主要内容如下：

按照《保荐管理办法》第六十六条的规定，我局决定：

认定肖晋为不适当人选，自监管措施决定作出之日起 10 年内不得担任证券公司债券承销业务相关职务或者实际履行上述职务。广发证券股份有限公司应当在收到认定为不适当人选决定书之日起 30 个工作日内，作出免除肖晋相关职务的决定，并在作出决定之日起 3 个工作日内向我局书面报告。

5、公司及林焕荣收到《行政监管措施决定书》的情况

2020 年 7 月 20 日，公司及林焕荣收到广东证监局《关于对林焕荣采取认定为不适当人选监管措施的决定》（中国证券监督管理委员会广东监管局行政监管措施决定书（2020）102 号），主要内容如下：

按照《债券管理办法》第五十八条、第六十三条的规定，我局决定：

认定林焕荣为不适当人选，自监管措施决定作出之日起 20 年内不得担任证券公司债券承销业务相关职务或者实际履行上述职务。广发证券股份有限公司应当在收到认定为不适当人选决定书之日起 30 个工作日内，作出免除林焕荣相关职务的决定，并在作出决定之日起 3 个工作日内向我局书面报告。

6、公司及许戈文收到《行政监管措施决定书》的情况

2020 年 7 月 20 日，公司及许戈文收到广东证监局《关于对许戈文采取认定为不适当人选监管措施的决定》（中国证券监督管理委员会广东监管局行政监管措施决定书（2020）103 号），主要内容如下：

按照《债券管理办法》第五十八条、第六十三条的规定，我局决定：

认定许戈文为不适当人选，自监管措施决定作出之日起 15 年内不得担任证券公司债券承销业务相关职务或者实际履行上述职务。广发证券股份有限公司应当在收到认定为不适当人选决定书之日起 30 个工作日内，作出免除许戈文相关职务的决定，并在作出决定之日起 3 个工

作日内向我局书面报告。

7、公司及李贤兵收到《行政监管措施决定书》的情况

2020 年 7 月 20 日，公司及李贤兵收到广东证监局《关于对李贤兵采取认定为不适当人选监管措施的决定》（中国证券监督管理委员会广东监管局行政监管措施决定书（2020）104 号），主要内容如下：

按照《债券管理办法》第五十八条、第六十三条的规定，我局决定：

认定李贤兵为不适当人选，自监管措施决定作出之日起 20 年内不得担任证券公司债券承销业务相关职务或者实际履行上述职务。广发证券股份有限公司应当在收到认定为不适当人选决定书之日起 30 个工作日内，作出免除李贤兵相关职务的决定，并在作出决定之日起 3 个工作日内向我局书面报告。

8、公司及何宽华收到《行政监管措施决定书》的情况

2020 年 7 月 20 日，公司及何宽华收到广东证监局《关于对何宽华采取认定为不适当人选监管措施的决定》（中国证券监督管理委员会广东监管局行政监管措施决定书（2020）105 号），主要内容如下：

按照《债券管理办法》第五十八条、第六十三条的规定，我局决定：

认定何宽华为不适当人选，自监管措施决定作出之日起 20 年内不得担任证券公司投资银行业务相关职务或者实际履行上述职务。广发证券股份有限公司应当在收到认定为不适当人选决定书之日起 30 个工作日内，作出免除何宽华相关职务的决定，并在作出决定之日起 3 个工作日内向我局书面报告。

如果对本监管措施不服，可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监管措施不停止执行。

三、其他相关人员收到《行政监管措施决定书》的情况

1、秦力收到《行政监管措施的决定书》的情况

2020 年 7 月 20 日，秦力收到广东证监局《关于对秦力采取公开谴责、监管谈话监管措施的决定》（中国证券监督管理委员会广东监管局行政监管措施决定书（2020）107 号），主要内容如下：

按照《证券公司监督管理条例》第七十条，《债券管理办法》第五十八条、第六十三条的规定，我局决定：

一、通过我局官方网站对你予以公开谴责。

二、对你采取监管谈话措施。

2、欧阳西收到《行政监管措施决定书》的情况

2020 年 7 月 20 日，欧阳西收到广东证监局《关于对欧阳西采取公开谴责、监管谈话监管措施的决定》（中国证券监督管理委员会广东监管局行政监管措施决定书（2020）106 号），主要内容如下：

按照《证券公司监督管理条例》第七十条、《保荐管理办法》第六十六条的规定，我局决定：

一、通过我局官方网站对你予以公开谴责。

二、对你采取监管谈话措施。

3、张威收到《行政监管措施决定书》的情况

2020 年 7 月 20 日，张威收到广东证监局《关于对张威采取监管谈话监管措施的决定》（中国证券监督管理委员会广东监管局行政监管措施决定书（2020）111 号），主要内容如下：

按照《债券管理办法》第五十八条、第六十三条的规定，我局决定对你采取监管谈话措施。

4、钟辉收到《行政监管措施决定书》的情况

2020 年 7 月 20 日，钟辉收到广东证监局《关于对钟辉采取监管谈话监管措施的决定》（中国证券监督管理委员会广东监管局行政监管措施决定书（2020）108 号），主要内容如下：

按照《保荐管理办法》第六十六条的规定，我局决定对你采取监管谈话措施。

5、黄旭辉收到《行政监管措施决定书》的情况

2020 年 7 月 20 日，黄旭辉收到广东证监局《关于对黄旭辉采取监管谈话监管措施的决定》（中国证券监督管理委员会广东监管局行政监管措施决定书（2020）109 号），主要内容如下：

按照《保荐管理办法》第六十六条的规定，我局决定对你采取监管谈话措施。

6、陈天喜收到《行政监管措施决定书》的情况

2020 年 7 月 20 日，陈天喜收到广东证监局《关于对陈天喜采取监管谈话监管措施的决定》（中国证券监督管理委员会广东监管局行政监管措施决定书（2020）110 号），主要内容如下：

按照《保荐管理办法》第六十六条的规定，我局决定对你采取监管谈话措施。

上述人员如果对本监管措施不服，可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监管措施不停止执行。

公司将深刻汲取教训、认真反思、严格落实整改要求，并按照内部问责制度对责任人员进行

内部问责。公司将建立健全和严格执行投行业务内控制度、工作流程和操作规范，切实提升投资银行业务质量。公司将全面强化责任、能力和职业操守建设，全面提升合规管理和风险管控水平。公司将严格遵循稳健经营理念，进一步强化“合规、诚信、专业、稳健”的文化建设，严守诚实守信、勤勉尽责的底线要求。

特此公告。

广发证券股份有限公司董事会

二〇二〇年七月二十一日

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。

中信证券

关于对中信证券股份有限公司北京紫竹院路证券营业部采取责令改正措施的决定，具体如下：

中信证券股份有限公司北京紫竹院路证券营业部：

经查，你营业部存在以下违规行为：

1. 存在多名客户开户资料重要信息填写缺失、未对高龄客户职业信息填写异常进行核实、同一客户同日填写的两份信息登记材料内容不一致、测评打分加总错误导致评级结果出现偏差等问题，违反了《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第（一）项、第（二）项及《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第六条第（一）项、第（二）项的规定。

2. 未按规定向我局报告营业部负责人孙丽丽任职情况，违反了《证券公司董事、监事和高级管理人员任职资格监管办法》第三十四条的规定。

3. 无法提供营业场所计算机设备及对应媒介访问控制地址（MAC 地址）的登记记录变更及历史登记数据，违反了《证券公司内部控制指引》第七条第（一）项的规定。

上述行为反映出你营业部内部控制不完善。根据《证券公司监督管理条例》第七十条及《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，我局决定责令你营业部限期改正，你营业部应当对存在的问题予以整改，完善内部控制机制，做好开户审核、人员任免备案、客户适当性管理工作，切实加强异常交易监控，防止营销人员在执业过程中从事违法违规或者超越代理权限、损害客户合法权益的行为。你营业部应于 2020 年 6 月 30 日前向我局报送书面整改报告。

如果对本监督管理措施不服，可在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。

对该证券的投资决策程序的说明：本基金管理人长期跟踪研究该公司，认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述通告对该公司证券的投资价值不产生重大影响。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。

交易商协会自律处分信息，具体如下：

中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）作为债务融资工具主承销商，在部分债务融资工具选聘主承销商的投标过程中，中标承销费率远低于市场正常水平，预估承销费收入远低于其业务开展平均成本。

依据相关自律规定，经 2020 年第 5 次自律处分会议审议，对中信证券予以警告，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

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。

申万宏源

关于对申万宏源证券有限公司采取责令改正措施的决定，具体如下：

申万宏源证券有限公司：

经查，你公司（统一社会信用代码：913100003244445565）子公司上海申银万国证券研究所有限公司（以下简称“研究所”）开展发布证券研究报告业务，但未对研究所署名证券分析师刘洋在冠以公司名称的公众号上发布的某篇证券研究报告进行发布前的质量控制和合规审查。上述行为不符合《发布证券研究报告暂行规定》（证监会公告[2010]28号）第十条的规定，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）第六条的规定。根据《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第133号）第三十二条的规定，我局决定对你公司采取责令改正的行政监管措施。你公司应高度重视，充分吸取教训，持续完善内部控制，切实提高合规管理水平，并自收到本决定之日起30日内向我局提交书面整改报告。

如果对本监督管理措施不服的，可以在收到本决定书之日起60日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请，也可以在收到本决定书之日起6个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。

复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行

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	1,047,154.13
2	应收证券清算款	15,445,906.85
3	应收股利	-
4	应收利息	18,453.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,511,514.66

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	689009	九号公司-UWD	7,666,378.72	0.49	锁定期股票
2	688180	君实生物-U	1,814,006.25	0.12	锁定期股票
3	601995	中金公司	1,714,383.21	0.11	锁定期股票
4	688536	思瑞浦	1,421,657.22	0.09	锁定期股票
5	300999	金龙鱼	640,367.37	0.04	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

报告期期初基金份额总额	1,074,697,982.00
报告期期间基金总申购份额	832,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	632,000,000.00

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,274,697,982.00

§ 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

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）《鹏华国证证券龙头交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华国证证券龙头交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华国证证券龙头交易型开放式指数证券投资基金 2020 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

2021 年 1 月 22 日