# 鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

## 2019 半年度 报告摘要

2019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：2019年8月23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。本半年度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2019年8月22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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年01月01日起至06月30日。

### §2 基金简介

2.1基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 鹏华沪深港新兴成长混合 |
| 基金主代码 | 003835 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年12月2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 | 18,543,620.18份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金为混合型基金，通过积极灵活的资产配置，并精选新兴成长主题股票，在有效控制风险前提下，力求超额收益与长期资本增值。 |
| 投资策略 | 1.资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。2.股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘A股和港股的优质公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1）自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2）自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。（1）新兴成长主题的定义 本基金所界定的新兴成长主题企业包括传统产业中具备新的成长动力的企业和新兴产业中业绩显著增长的企业。1）传统产业是指在历史上曾经高速增长，但目前发展速度趋缓，进入成熟阶段，资源消耗大和环保水平低的产业。随着我国经济模式的主动和被动调整、新技术的产生、新的商业模式的出现、生产方式的不断升级以及行业并购重组整合的加剧，传统产业中也会不断出现具有成长性、未来发展前景好的公司。发展较为成熟的上市公司，因不断更新生产技术、不断完善经营模式等使其具备良好的成长前景，以及传统产业中涌现的具备新技术、新经营理念的新兴上市公司，均属于本基金的投资主题。2）新兴产业是指以重大技术突破和重大发展需求为基础，对经济社会全局和长远发展具有重大引领带动作用，知识技术密集、物质资源消耗少、成长潜力大、综合效益好的产业。参考国家战略新兴产业选择标准，本基金所指的新兴产业包括但不限于：节能环保、医药生物、新能源材料、军工、互联网、新一代信息技术、医疗健康、新兴消费行业等。未来如果基金管理人认为有更适当的新兴成长主题的划分标准，基金管理人有权对上述界定方法进行变更。本基金由于上述原因变更界定方法不需经基金份额持有人大会通过，但应及时告知基金托管人并公告。若因基金管理人界定方法的调整等原因导致本基金持有的新兴成长主题的证券的比例低于非现金基金资产的80%，本基金将在三十个交易日之内进行调整。（2）自上而下的行业遴选 本基金将自上而下地进行行业遴选，重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素。对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度，以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键要素的判断，为选择企业经营状况的变化建立扎实的基础。（3）自下而上的个股选择 本基金通过定性和定量相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，精选优质个股。1）定性分析 本基金通过以下两方面标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出优质的公司：一方面是竞争力分析，通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的公司或未来具有广阔成长空间的公司。就公司竞争策略，基于行业分析的结果判断策略的有效性、策略的实施支持和策略的执行成果；就核心竞争力，分析公司的现有核心竞争力，并判断公司能否利用现有的资源、能力和定位取得可持续竞争优势。另一方面是管理层分析，通过着重考察公司的管理层以及管理制度，选择具有良好治理结构、管理水平较高的优质公司。2）定量分析 本基金通过对公司定量的估值分析，挖掘优质的投资标的。通过对估值方法的选择和估值倍数的比较，选择股价相对低估的股票。就估值方法而言，基于行业的特点确定对股价最有影响力的关键估值方法（包括PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA等）；就估值倍数而言，通过业内比较、历史比较和增长性分析，确定具有上升基础的股价水平。（4）港股通标的投资策略 除新兴成长主题的投资标的之外，本基金还将关注以下几类港股通标的：1）在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司；2）具有行业稀缺性的香港本地和外资公司；3）港股市场在行业结构、估值、AH股折溢价、股息率等方面具有吸引力的投资标的。3.债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。（1）久期策略 久期管理是债券投资的重要考量因素，本基金将采用以"目标久期"为中心、自上而下的组合久期管理策略。（2）收益率曲线策略 收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配，并进行动态调整。（3）骑乘策略 本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略，以达到增强组合的持有期收益的目的。（4）息差策略 本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。（5）个券选择策略 本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。（6）信用策略 本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价，根据内、外部信用评级结果，结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。4.权证投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。5.中小企业私募债投资策略 中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性，普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况，合理合规地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况，尽力规避风险，并获取超额收益。6.股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。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 | 沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30% |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。 |

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 | 田青 |
| | 联系电话 | 0755-82825720 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | zhangge@phfund.com.cn | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 4006788999 | 010-67595096 |
| 传真 | | 0755-82021126 | 010-66275853 |

2.4信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.phfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 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 |

### §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(2019年1月1日－2019年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 1,964,971.50 |
| 本期利润 | 1,998,642.18 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1098 |
| 本期基金份额净值增长率 | 15.59% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2922 |
| 期末基金资产净值 | 25,977,542.04 |
| 期末基金份额净值 | 1.401 |

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）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。

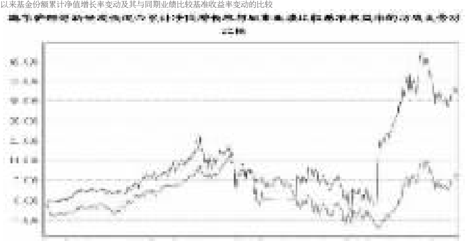
3.2基金净值表现

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 | 3.55% | 0.89% | 3.94% | 0.81% | -0.39% | 0.08% |
| 过去三个月 | -2.03% | 1.24% | -0.50% | 1.06% | -1.53% | 0.18% |
| 过去六个月 | 15.59% | 1.29% | 19.33% | 1.08% | -3.74% | 0.21% |
| 过去一年 | 29.01% | 1.55% | 8.73% | 1.07% | 20.28% | 0.48% |
| 自基金成立起至今 | 40.10% | 1.21% | 8.91% | 0.81% | 31.19% | 0.40% |

注：业绩比较基准=沪深300指数收益率*70%+中证综合债指数收益率*30%

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



注：1.本基金基金合同于 2016年12月02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。公司原注册资本8,000 万元人民币，后于2001年9月完成增资扩股，增至15,000 万元人民币。截止到2019年6月，公司管理资产总规模达到5,644.95亿元，管理159只公募基金、10只全国社保投资组合、4只基本养老保险投资组合。

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 | | |
| 尤柏年 | 本基金基金经理 | 2016-12-28 | - | 15 | 尤柏年先生，国籍中国，经济学博士，15年证券基金从业经验。历任澳大利亚BConnect公司Apex投资咨询团队分析师，华宝兴业基金管理有限公司金融工程部高级数量分析师、海外投资管理部高级分析师、基金经理助理，华宝兴业成熟市场基金和华宝兴业标普油气基金基金经理等职；2014年7月加盟鹏华基金管理有限公司，历任国际业务部副总经理，现担任国际业务部总经理、基金经理。2014年08月担任鹏华全球高收益债基金基金经理，2014年09月担任鹏华环球发现（QDII-FOF）基金基金经理，2015年07月担任鹏华前海万科REITs基金基金经理，2016年12月担任鹏华沪深港新兴成长混合基金基金经理，2017年11月担任鹏华港美互联股票（LOF）基金基金经理，2017年11月担任鹏华香港银行指数（LOF）基金基金经理，2017年11月担任鹏华香港中小企业指数（LOF）基金基金经理。尤柏年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。 |
| 胡东健 | 本基金基金经理 | 2016-12-02 | 2019-07-03 | 8 | 胡东健先生，国籍中国，经济学硕士，8年证券基金从业经验。历任融通基金管理有限公司研究员；2015年1月加盟鹏华基金管理有限公司，担任高级研究员，从事投资研究工作，现任权益投资二部基金经理。2015年06月至2019年04月担任鹏华价值精选股票基金基金经理，2015年12月至2017年07月担任鹏华优质治理混合（LOF）基金基金经理，2016年12月至2019年07月担任鹏华沪深港新兴成长混合基金基金经理，2017年04月至2018年05月担任鹏华沪深港互联网基金基金经理。胡东健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

2019年上半年，市场较去年底有所反弹，其中A股市场走势强于港股市场。在经历了一季度的快速估值修复之后，二季度港股及国内市场波动加大，先涨后跌再反弹，整体较一季度有所回调。市场行情从一季度的估值修复和资金驱动，转为宏观主导。4月份各数据继续上行，4月下旬开始国内政策面和资金面出现边际变化，带动指数进入调整，进入5月，中美贸易谈判再次出现波折，市场继续下探。6月开始，随着中美谈判出现缓和迹象，叠加市场对G20会谈出现乐观预期，市场出现恢复性上涨。总体来看，上半年上证综指上涨19.45%，深圳成指上涨26.78%。恒生指数上涨10.43%，恒生国企指数上涨7.48%。

本基金在上半年采取了一定的择时策略。尤其是在4月下旬市场出现边际变化以后，较为及时地降低持仓占比，使得基金在市场回调时候减少了损失。此外，二季度开始，本基金满足了新股线下申购的要求，开始参与新股投资，也对基金净值产生了一定正面贡献。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金报告期末单位净值为1.401，累计净值为1.401，较期初上涨约15.6%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为市场在外部环境改善的带动下短期内会延续反弹，但是宏观经济下行压力仍大，且中美贸易谈判仍存在不确定性，在指数反弹以后，仍需关注宏观经济超预期下行和外部冲击带来的二次探底。行业方面，我们认为在经济下行压力加大的情形下，受益于宏观对冲政策支持的行业有机会出现超额收益。此外受到科创板的带动，优质的科技创新型企业也有上行动力。资金面方面，预计外资仍将持续流入。

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

基金的日常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帐务处理；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、金融工程部、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

1.截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为5,419,348.10元，期末基金份额净值1.401元。

2.本基金本报告期内未进行利润分配。

3.根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

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

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人及相关机构正在就可行的解决方案进行探讨论证。

### §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托管人对本半年度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：鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

| 资 产 | 本期末<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产： | | |
| 银行存款 | 4,282,492.51 | 228,656.04 |
| 结算备付金 | 883,659.93 | 16,221.05 |
| 存出保证金 | 348,761.44 | 13,238.12 |
| 交易性金融资产 | 22,462,960.60 | 664,552.57 |
| 其中：股票投资 | 22,462,960.60 | 664,552.57 |
| 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 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | 577,245.87 | - |
| 应收利息 | 1,286.13 | 70.00 |
| 应收股利 | 28,800.00 | - |
| 应收申购款 | 43,678.07 | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 28,628,884.55 | 922,737.78 |
| 负债和所有者权益 | 本期末<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
| 负 债： | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | 1,246,440.01 | 0.10 |
| 应付赎回款 | 1,266,101.37 | - |
| 应付管理人报酬 | 13,097.05 | 378.65 |
| 应付托管费 | 5,457.09 | 157.77 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 97,497.85 | 5,334.58 |
| 应交税费 | 205.53 | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 22,543.61 | 35,000.00 |
| 负债合计 | 2,651,342.51 | 40,871.10 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 18,543,620.18 | 727,592.28 |
| 未分配利润 | 7,433,921.86 | 154,274.40 |
| 所有者权益合计 | 25,977,542.04 | 881,866.68 |
| 负债和所有者权益总计 | 28,628,884.55 | 922,737.78 |

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.401元，基金份额总额18,543,620.18份。

6.2利润表

会计主体：鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 2,535,127.24 | -19,990,495.81 |
| 1.利息收入 | | 27,165.85 | 225,951.39 |
| 其中：存款利息收入 | | 27,029.31 | 160,157.56 |
| 债券利息收入 | | 136.54 | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | 65,793.83 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以"-"填列） | | 2,212,851.34 | -10,512,270.72 |
| 其中：股票投资收益 | | 1,900,128.32 | -10,530,890.37 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 12,187.50 | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | 25,042.48 | - |
| 股利收益 | | 275,493.04 | 18,619.65 |
| 3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列） | | 33,692.71 | -9,797,109.46 |
| 4.汇兑收益（损失以"-"号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以"-"号填列） | | 261,417.34 | 92,932.98 |
| 减：二、费用 | | 536,485.06 | 2,761,483.87 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.8.2.1 | 74,164.78 | 428,174.50 |
| 2.托管费 | 6.4.8.2.2 | 30,901.96 | 178,405.99 |
| 3.销售服务费 | 6.4.8.2.3 | - | - |
| 4.交易费用 | | 409,171.18 | 1,927,378.54 |
| 5.利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6.税金及附加 | | 115.25 | - |
| 7.其他费用 | | 22,131.89 | 227,524.84 |
| 三、利润总额（亏损总额以"-"号填列） | | 1,998,642.18 | -22,751,979.68 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以"-"号填列） | | 1,998,642.18 | -22,751,979.68 |

6.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>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） | 727,592.28 | 154,274.40 | 881,866.68 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 1,998,642.18 | 1,998,642.18 |
| 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） | 17,816,027.90 | 5,281,005.28 | 23,097,033.18 |
| 其中：1.基金申购款 | 50,559,105.86 | 18,780,027.42 | 69,339,133.28 |
| 2.基金赎回款 | -32,743,077.96 | -13,499,022.14 | -46,242,100.10 |
| 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） | 18,543,620.18 | 7,433,921.86 | 25,977,542.04 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018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） | 236,096,143.44 | 33,754,305.80 | 269,850,449.24 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -22,751,979.68 | -22,751,979.68 |
| 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） | -235,642,635.41 | -10,963,334.54 | -246,605,969.95 |
| 其中：1.基金申购款 | 16,499,339.68 | 165,266.79 | 16,664,606.47 |
| 2.基金赎回款 | -252,141,975.09 | -11,128,601.33 | -263,270,576.42 |
| 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） | 453,508.03 | 38,991.58 | 492,499.61 |

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：

| 邓召明 | 苏波 | 郝文高 |
|---|---|---|
| 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

鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金(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]2638号《关于准予鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予，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《鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型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，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430,388,047.00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（2016）第1599号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月2日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为430,388,068.84份基金份额，其中认购资金利息折合21.84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《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0%－95%（其中投资于国内依法发行的股票的比例占基金资产的0－95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0－95%）；投资于新兴成长主题的公司发行的证券占非现金基金资产的比例不低于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，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。本基金业绩比较基准为：沪深300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%。

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〈年度报告和半年度报告〉》、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》、《鹏华沪深港新兴成长灵活配置混合型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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于2019年上半年内，本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍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2019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2019年6月30日的财务状况以及2019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[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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中国结算")提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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关联方关系

6.4.7.1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。

6.4.7.2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 |
|---|---|
| 国信证券股份有限公司（"国信证券"） | 基金管理人的股东 |
| 鹏华基金管理有限公司（"鹏华基金公司"） | 基金管理人、基金注册登记机构、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 |

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。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018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 | - | - | 54,175,995.02 | 5.27 |

6.4.8.1.2债券交易

注：无。

6.4.8.1.3债券回购交易

注：无。

6.4.8.1.4权证交易

注：无。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>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 | - | - | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018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 | 54,175.83 | 5.51 | - | - |

注：（1）佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=买（卖）成交金额×1‰－买（卖）经手费－买（卖）证管费等由券商承担的费用

深圳证券交易所的交易佣金=买（卖）成交金额×1‰－买（卖）经手费－买（卖）证管费等由券商承担的费用

债券及回购交易免费并不计交易佣金，其所计提的债券及回购买卖经手费、证管费及证券结算风险金均由基金资产承担。

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议约定。）

（2）本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易单元租用协议》。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。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 74,164.78 | 428,174.50 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 31,967.12 | 352.09 |

注：1.支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为0.60%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.60%÷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。

6.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 30,901.96 | 178,405.99 |

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费年费率为0.25%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.8.2.3销售服务费

注：无。

6.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1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。

6.4.8.4.2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未投资及持有本基金份额。

6.4.8.5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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018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 | 4,282,492.51 | 21,169.15 | 16,375,594.27 | 120,518.95 |

6.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与本管理人、管理人控股股东、托管人、委托人及委托人控股股东承销的证券。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1银行间市场债券正回购

注：无。

6.4.9.3.2交易所市场债券正回购

无。

6.4.10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 | 22,462,960.60 | 78.46 |
| | 其中：股票 | 22,462,960.60 | 78.46 |
| 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 | 5,166,152.44 | 18.05 |
| 8 | 其他各项资产 | 999,771.51 | 3.49 |
| 9 | 合计 | 28,628,884.55 | 100.00 |

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为4,590,681.64元，占净值比为17.67%。

7.2报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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 | 18,168.90 | 0.07 |
| C | 制造业 | 10,603,826.17 | 40.82 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 64,800.00 | 0.25 |
| E | 建筑业 | 396,280.00 | 1.53 |
| F | 批发和零售业 | 539,018.00 | 2.07 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 647,225.00 | 2.49 |
| H | 住宿和餐饮业 | 719,200.00 | 2.77 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 687,348.64 | 2.65 |
| J | 金融业 | 3,522,032.25 | 13.56 |
| K | 房地产业 | 255,200.00 | 0.98 |
| L | 租赁和商务服务业 | 303,480.00 | 1.17 |
| 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 | 115,700.00 | 0.45 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 17,872,278.96 | 68.80 |

7.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| 能源 | - | - |
| 原材料 | 28,764.88 | 0.11 |
| 工业 | 1,046,443.54 | 4.03 |
| 非日常生活消费品 | - | - |
| 日常消费品 | - | - |
| 医疗保健 | - | - |
| 金融 | 1,451,790.86 | 5.59 |
| 信息技术 | 2,063,682.36 | 7.94 |
| 通讯服务 | - | - |
| 公用事业 | - | - |
| 房地产 | - | - |
| 电信服务 | - | - |
| 非周期性消费品 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 公用事业 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 能源 | - | - |
| 信息科技 | - | - |
| 医疗 | - | - |
| 原材料 | - | - |
| 周期性消费品 | - | - |
| 合计 | 4,590,681.64 | 17.67 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3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

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 | 00700 | 腾讯控股 | 6,000 | 1,861,008.70 | 7.16 |
| 2 | 600030 | 中信证券 | 35,000 | 833,350.00 | 3.21 |
| 2 | 06030 | 中信证券 | 30,000 | 429,625.94 | 1.65 |
| 3 | 601992 | 金隅集团 | 300,000 | 1,128,000.00 | 4.34 |
| 4 | 002304 | 洋河股份 | 9,000 | 1,094,040.00 | 4.21 |
| 5 | 601288 | 农业银行 | 300,000 | 1,080,000.00 | 4.16 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 20,000 | 1,037,200.00 | 3.99 |
| 7 | 06066 | 中信建投证券 | 200,000 | 1,022,164.92 | 3.93 |
| 8 | 600196 | 复星医药 | 40,000 | 1,012,000.00 | 3.90 |
| 9 | 600887 | 伊利股份 | 30,000 | 1,002,300.00 | 3.86 |
| 10 | 01055 | 中国南方航空股份 | 100,000 | 478,535.04 | 1.84 |
| 10 | 600029 | 南方航空 | 50,000 | 386,000.00 | 1.49 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于鹏华基金管理有限公司网站http://www.phfund.com.cn的半年度报告正文。

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 | 00700 | 腾讯控股 | 4,381,247.90 | 496.82 |
| 2 | 06066 | 中信建投证券 | 3,056,523.23 | 346.60 |
| 3 | 000401 | 冀东水泥 | 2,530,250.00 | 286.92 |
| 4 | 00763 | 中兴通讯 | 2,525,237.79 | 286.35 |
| 5 | 002304 | 洋河股份 | 2,315,852.44 | 262.61 |
| 6 | 000063 | 中兴通讯 | 2,216,719.00 | 251.37 |
| 7 | 300170 | 汉得信息 | 2,137,676.00 | 242.40 |
| 8 | 600111 | 北方稀土 | 2,022,535.00 | 229.35 |
| 9 | 600196 | 复星医药 | 2,004,239.32 | 227.27 |
| 10 | 600073 | 上海梅林 | 1,940,978.74 | 220.10 |
| 11 | 601992 | 金隅集团 | 1,938,130.00 | 219.78 |
| 12 | 600048 | 保利地产 | 1,811,029.00 | 205.36 |
| 13 | 002236 | 大华股份 | 1,810,275.00 | 205.28 |
| 14 | 000002 | 万 科A | 1,799,031.37 | 204.00 |
| 15 | 600887 | 伊利股份 | 1,587,993.00 | 180.07 |
| 16 | 000858 | 五 粮 液 | 1,573,270.00 | 178.40 |
| 17 | 000983 | 西山煤电 | 1,565,524.00 | 177.52 |
| 18 | 01638 | 佳兆业集团 | 1,559,541.32 | 176.85 |
| 19 | 601288 | 农业银行 | 1,499,010.00 | 169.98 |
| 20 | 300017 | 网宿科技 | 1,493,308.00 | 169.33 |
| 21 | 01336 | 新华保险 | 1,482,643.56 | 168.13 |
| 22 | 002624 | 完美世界 | 1,477,437.00 | 167.54 |
| 23 | 603517 | 绝味食品 | 1,449,164.50 | 164.33 |
| 24 | 00880 | 澳博控股 | 1,429,036.66 | 162.05 |
| 25 | 00762 | 中国联通 | 1,412,269.54 | 160.15 |
| 26 | 000732 | 泰禾集团 | 1,378,776.40 | 156.35 |
| 27 | 00288 | 万洲国际 | 1,366,830.64 | 154.99 |
| 28 | 00563 | 上实城市开发 | 1,359,279.45 | 154.14 |
| 29 | 601998 | 中信银行 | 1,303,000.00 | 147.75 |
| 30 | 603197 | 保隆科技 | 1,291,271.40 | 146.42 |
| 31 | 000333 | 美的集团 | 1,261,720.00 | 143.07 |
| 32 | 002415 | 海康威视 | 1,159,826.00 | 131.52 |
| 33 | 02208 | 金风科技 | 1,136,436.72 | 128.87 |
| 34 | 002398 | 建研集团 | 1,112,418.94 | 126.14 |
| 35 | 601611 | 中国核建 | 1,103,921.00 | 125.18 |
| 36 | 00966 | 中国太平 | 1,088,240.11 | 123.40 |
| 37 | 00691 | 山水水泥 | 1,076,596.70 | 122.08 |
| 38 | 600029 | 南方航空 | 1,046,653.00 | 118.69 |
| 39 | 002127 | 南极电商 | 1,022,753.00 | 115.98 |
| 40 | 000651 | 格力电器 | 1,001,737.00 | 113.59 |
| 41 | 600977 | 中国电影 | 1,000,171.00 | 113.42 |
| 42 | 03323 | 中国建材 | 999,459.11 | 113.33 |
| 43 | 603993 | 洛阳钼业 | 984,200.00 | 111.60 |
| 44 | 300168 | 万达信息 | 982,539.00 | 111.42 |
| 45 | 300498 | 温氏股份 | 980,172.00 | 111.15 |
| 46 | 02001 | 新高教集团 | 955,679.47 | 108.37 |
| 47 | 600718 | 东软集团 | 950,189.00 | 107.75 |
| 48 | 600352 | 浙江龙盛 | 944,300.00 | 107.08 |
| 49 | 00285 | 比亚迪电子 | 927,976.14 | 105.23 |
| 50 | 01813 | 合景泰富集团 | 927,388.02 | 105.16 |
| 51 | 002384 | 东山精密 | 898,208.00 | 101.85 |
| 52 | 600050 | 中国联通 | 893,700.00 | 101.34 |
| 53 | 03377 | 远洋集团 | 885,649.46 | 100.43 |
| 54 | 00895 | 东江环保 | 867,685.58 | 98.39 |
| 55 | 600699 | 均胜电子 | 843,321.00 | 95.63 |
| 56 | 002508 | 老板电器 | 801,800.00 | 90.92 |
| 57 | 06030 | 中信证券 | 800,403.15 | 90.76 |
| 58 | 601009 | 南京银行 | 796,019.00 | 90.27 |
| 59 | 600030 | 中信证券 | 792,891.00 | 89.91 |
| 60 | 600622 | 光大嘉宝 | 779,512.00 | 88.39 |
| 61 | 03888 | 金山软件 | 774,412.32 | 87.82 |
| 62 | 600809 | 山西汾酒 | 774,146.00 | 87.78 |
| 63 | 000977 | 浪潮信息 | 736,429.29 | 83.51 |
| 64 | 601336 | 新华保险 | 716,148.00 | 81.21 |
| 65 | 00354 | 中国软件国际 | 695,028.27 | 78.81 |
| 66 | 600258 | 首旅酒店 | 682,430.00 | 77.38 |
| 67 | 000423 | 东阿阿胶 | 680,835.00 | 77.20 |
| 68 | 603713 | 密尔克卫 | 677,925.00 | 76.87 |
| 69 | 600519 | 贵州茅台 | 659,054.00 | 74.73 |
| 70 | 01970 | IMAX CHINA | 657,208.91 | 74.52 |
| 71 | 600373 | 中文传媒 | 653,525.00 | 74.11 |
| 72 | 601318 | 中国平安 | 646,616.00 | 73.32 |
| 73 | 00665 | 海通国际 | 643,732.29 | 73.00 |
| 74 | 01234 | 中国利郎 | 621,037.51 | 70.42 |
| 75 | 002847 | 盐津铺子 | 589,405.00 | 66.84 |
| 76 | 300454 | 深信服 | 582,472.00 | 66.05 |
| 77 | 02628 | 中国人寿 | 568,712.34 | 64.49 |
| 78 | 01347 | 华虹半导体 | 566,917.41 | 64.29 |
| 79 | 02382 | 舜宇光学科技 | 563,436.80 | 63.89 |
| 80 | 02388 | 中银香港 | 563,380.07 | 63.88 |
| 81 | 600426 | 华鲁恒升 | 562,197.00 | 63.75 |
| 82 | 601328 | 交通银行 | 545,604.00 | 61.87 |
| 83 | 300770 | 新媒股份 | 540,947.95 | 61.34 |
| 84 | 000538 | 云南白药 | 526,213.00 | 59.67 |
| 85 | 03383 | 雅居乐集团 | 508,034.87 | 57.61 |
| 86 | 000895 | 双汇发展 | 495,835.00 | 56.23 |
| 87 | 03311 | 中国建筑国际 | 488,452.87 | 55.39 |
| 88 | 00011 | 恒生银行 | 486,308.25 | 55.15 |
| 89 | 01055 | 中国南方航空股份 | 478,722.89 | 54.29 |
| 90 | 000100 | TCL集团 | 477,913.00 | 54.19 |
| 91 | 600060 | 海信电器 | 473,440.00 | 53.69 |
| 92 | 002475 | 立讯精密 | 472,738.00 | 53.61 |
| 93 | 603357 | 设计总院 | 470,339.00 | 53.33 |
| 94 | 03933 | 联邦制药 | 463,731.03 | 52.59 |
| 95 | 002456 | 欧菲光 | 455,694.00 | 51.67 |
| 96 | 002572 | 索菲亚 | 449,848.52 | 51.01 |
| 97 | 601012 | 隆基股份 | 444,544.00 | 50.41 |
| 98 | 00189 | 东岳集团 | 443,663.15 | 50.31 |
| 99 | 00337 | 绿地香港 | 443,634.62 | 50.31 |
| 100 | 601001 | 大同煤业 | 442,750.00 | 50.21 |
| 101 | 000560 | 我爱我家 | 436,046.00 | 49.45 |
| 102 | 600585 | 海螺水泥 | 428,700.00 | 48.61 |
| 103 | 01313 | 华润水泥控股 | 428,602.40 | 48.60 |
| 104 | 600312 | 平高电气 | 423,360.00 | 48.01 |
| 105 | 300003 | 乐普医疗 | 422,723.00 | 47.94 |
| 106 | 00384 | 中国燃气 | 414,709.81 | 47.03 |
| 107 | 03618 | 重庆农村商业银行 | 412,688.40 | 46.80 |
| 108 | 02238 | 广汽集团 | 412,321.86 | 46.76 |
| 109 | 000915 | 山大华特 | 411,854.00 | 46.70 |
| 110 | 601111 | 中国国航 | 397,303.00 | 45.05 |
| 111 | 600325 | 华发股份 | 393,000.00 | 44.56 |
| 112 | 01999 | 敏华控股 | 391,694.33 | 44.42 |
| 113 | 601899 | 紫金矿业 | 363,000.00 | 41.16 |
| 114 | 600115 | 东方航空 | 362,029.52 | 41.05 |
| 115 | 002174 | 游族网络 | 347,071.00 | 39.36 |
| 116 | 00175 | 吉利汽车 | 346,919.79 | 39.34 |
| 117 | 603369 | 今世缘 | 335,717.00 | 38.07 |
| 118 | 000963 | 华东医药 | 319,398.00 | 36.22 |
| 119 | 002468 | 申通快递 | 316,364.00 | 35.87 |
| 120 | 002463 | 沪电股份 | 307,887.00 | 34.91 |
| 121 | 01569 | 民生教育 | 302,945.79 | 34.35 |
| 122 | 00119 | 保利置业集团 | 298,875.24 | 33.89 |
| 123 | 002142 | 宁波银行 | 294,993.98 | 33.45 |
| 124 | 01888 | 建滔积层板 | 285,555.03 | 32.38 |
| 125 | 000069 | 华侨城A | 279,400.00 | 31.68 |
| 126 | 02233 | 西部水泥 | 277,392.60 | 31.46 |
| 127 | 300474 | 景嘉微 | 276,533.00 | 31.36 |
| 128 | 01788 | 国泰君安国际 | 275,754.87 | 31.27 |
| 129 | 601800 | 中国交建 | 275,520.00 | 31.24 |
| 130 | 300568 | 星源材质 | 268,623.00 | 30.46 |
| 131 | 00753 | 中国国航 | 259,552.93 | 29.43 |
| 132 | 601601 | 中国太保 | 252,466.00 | 28.63 |
| 133 | 000088 | 盐 田 港 | 248,000.00 | 28.12 |
| 134 | 02009 | 金隅集团 | 247,973.85 | 28.12 |
| 135 | 002234 | 民和股份 | 243,015.00 | 27.56 |
| 136 | 03339 | 中国龙工 | 241,962.17 | 27.44 |
| 137 | 01610 | 中粮肉食 | 239,978.64 | 27.21 |
| 138 | 00998 | 中信银行 | 239,609.11 | 27.17 |
| 139 | 300207 | 欣旺达 | 239,408.00 | 27.15 |
| 140 | 02357 | 中航科工 | 235,336.75 | 26.69 |
| 141 | 02018 | 瑞声科技 | 232,769.44 | 26.40 |
| 142 | 01658 | 邮储银行 | 223,502.29 | 25.34 |
| 143 | 601021 | 春秋航空 | 218,640.00 | 24.79 |
| 144 | 00390 | 中国中铁 | 215,395.83 | 24.42 |
| 145 | 002129 | 中环股份 | 196,832.00 | 22.32 |
| 146 | 02333 | 长城汽车 | 193,164.40 | 21.90 |
| 147 | 601933 | 永辉超市 | 189,800.00 | 21.52 |
| 148 | 601233 | 桐昆股份 | 182,500.00 | 20.69 |
| 149 | 600038 | 中直股份 | 181,120.00 | 20.54 |
| 150 | 002405 | 四维图新 | 177,940.00 | 20.18 |
| 151 | 01238 | 宝龙地产 | 172,211.82 | 19.53 |
| 152 | 600004 | 白云机场 | 172,158.00 | 19.52 |
| 153 | 03380 | 龙光地产 | 171,587.52 | 19.46 |
| 154 | 600845 | 宝信软件 | 170,213.00 | 19.30 |
| 155 | 01093 | 石药集团 | 168,749.50 | 19.14 |
| 156 | 601988 | 中国银行 | 167,700.00 | 19.02 |
| 157 | 600068 | 葛洲坝 | 152,600.00 | 17.30 |
| 158 | 02318 | 中国平安 | 152,061.39 | 17.24 |
| 159 | 01988 | 民生银行 | 150,040.33 | 17.01 |
| 160 | 000876 | 新 希 望 | 147,827.00 | 16.76 |
| 161 | 000400 | 许继电气 | 147,012.00 | 16.67 |
| 162 | 00867 | 康哲药业 | 146,458.15 | 16.61 |
| 163 | 601088 | 中国神华 | 143,640.00 | 16.29 |
| 164 | 002233 | 塔牌集团 | 143,200.00 | 16.24 |
| 165 | 03808 | 中国重汽 | 141,598.05 | 16.06 |
| 166 | 000786 | 北新建材 | 139,860.00 | 15.86 |
| 167 | 300059 | 东方财富 | 137,400.00 | 15.58 |
| 168 | 600989 | 宝丰能源 | 135,419.36 | 15.36 |
| 169 | 01072 | 东方电气 | 135,111.41 | 15.32 |
| 170 | 01963 | 重庆银行 | 134,478.24 | 15.25 |
| 171 | 603589 | 口子窖 | 132,420.00 | 15.02 |
| 172 | 03908 | 中金公司 | 131,586.98 | 14.92 |
| 173 | 600104 | 上汽集团 | 130,693.00 | 14.82 |
| 174 | 06818 | 中国光大银行 | 126,734.06 | 14.37 |
| 175 | 603583 | 捷昌驱动 | 123,733.00 | 14.03 |
| 176 | 002507 | 涪陵榨菜 | 117,619.00 | 13.34 |
| 177 | 002366 | 台海核电 | 116,500.00 | 13.21 |
| 178 | 300144 | 宋城演艺 | 111,643.00 | 12.66 |
| 179 | 00751 | 创维数码 | 103,655.30 | 11.75 |
| 180 | 01458 | 周黑鸭 | 101,295.59 | 11.49 |
| 181 | 00590 | 六福集团 | 97,798.17 | 11.09 |
| 182 | 02601 | 中国太保 | 86,273.15 | 9.78 |
| 183 | 000776 | 广发证券 | 80,000.00 | 9.07 |
| 184 | 600019 | 宝钢股份 | 78,200.00 | 8.87 |
| 185 | 000783 | 长江证券 | 75,000.00 | 8.50 |
| 186 | 600919 | 江苏银行 | 71,700.00 | 8.13 |
| 187 | 002377 | 国创高新 | 71,600.00 | 8.12 |
| 188 | 001979 | 招商蛇口 | 69,180.00 | 7.84 |
| 189 | 02007 | 碧桂园 | 67,430.48 | 7.65 |
| 190 | 600578 | 京能电力 | 66,800.00 | 7.57 |
| 191 | 601628 | 中国人寿 | 61,760.00 | 7.00 |
| 192 | 06837 | 海通证券 | 59,779.63 | 6.78 |
| 193 | 601607 | 上海医药 | 59,490.00 | 6.75 |
| 194 | 000166 | 申万宏源 | 54,900.00 | 6.23 |
| 195 | 601898 | 中煤能源 | 54,800.00 | 6.21 |
| 196 | 02689 | 玖龙纸业 | 51,882.11 | 5.88 |
| 197 | 002008 | 大族激光 | 41,660.00 | 4.72 |
| 198 | 02799 | 中国华融 | 38,306.54 | 4.34 |
| 199 | 002024 | 苏宁易购 | 37,350.00 | 4.24 |
| 200 | 002955 | 鸿合科技 | 34,800.24 | 3.95 |
| 201 | 000600 | 建投能源 | 32,880.00 | 3.73 |
| 202 | 601166 | 兴业银行 | 30,620.00 | 3.47 |
| 203 | 03968 | 招商银行 | 25,339.24 | 2.87 |
| 204 | 01030 | 新城发展控股 | 18,901.23 | 2.14 |

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 | 00763 | 中兴通讯 | 2,838,604.20 | 321.89 |
| 2 | 00700 | 腾讯控股 | 2,671,473.38 | 302.93 |
| 3 | 000063 | 中兴通讯 | 2,218,775.00 | 251.60 |
| 4 | 300170 | 汉得信息 | 1,973,586.00 | 223.80 |
| 5 | 600111 | 北方稀土 | 1,928,266.00 | 218.66 |
| 6 | 002236 | 大华股份 | 1,887,356.00 | 214.02 |
| 7 | 06066 | 中信建投证券 | 1,879,671.09 | 213.15 |
| 8 | 600073 | 上海梅林 | 1,838,371.00 | 208.46 |
| 9 | 000401 | 冀东水泥 | 1,793,439.00 | 203.37 |
| 10 | 000002 | 万 科A | 1,777,081.00 | 201.51 |
| 11 | 01638 | 佳兆业集团 | 1,734,554.43 | 196.69 |
| 12 | 002624 | 完美世界 | 1,563,762.00 | 177.32 |
| 13 | 600352 | 浙江龙盛 | 1,563,311.00 | 177.27 |
| 14 | 600048 | 保利地产 | 1,538,955.00 | 174.51 |
| 15 | 01336 | 新华保险 | 1,492,512.24 | 169.24 |
| 16 | 00762 | 中国联通 | 1,478,075.79 | 167.61 |
| 17 | 000983 | 西山煤电 | 1,470,147.00 | 166.71 |
| 18 | 000732 | 泰禾集团 | 1,461,648.00 | 165.74 |
| 19 | 00288 | 万洲国际 | 1,424,059.66 | 161.48 |
| 20 | 300017 | 网宿科技 | 1,412,054.26 | 160.12 |
| 21 | 00563 | 上实城市开发 | 1,383,887.79 | 156.93 |
| 22 | 00880 | 澳博控股 | 1,363,914.33 | 154.66 |
| 23 | 603197 | 保隆科技 | 1,287,646.00 | 146.01 |
| 24 | 601611 | 中国核建 | 1,272,718.00 | 144.32 |
| 25 | 603517 | 绝味食品 | 1,254,483.90 | 142.25 |
| 26 | 002304 | 洋河股份 | 1,206,223.00 | 136.78 |
| 27 | 00691 | 山水水泥 | 1,197,292.48 | 135.77 |
| 28 | 02208 | 金风科技 | 1,176,785.83 | 133.44 |
| 29 | 002398 | 建研集团 | 1,160,372.00 | 131.58 |
| 30 | 00966 | 中国太平 | 1,153,646.88 | 130.82 |
| 31 | 002415 | 海康威视 | 1,125,403.95 | 127.62 |
| 32 | 000651 | 格力电器 | 1,032,144.00 | 117.04 |
| 33 | 01813 | 合景泰富集团 | 1,025,517.28 | 116.29 |
| 34 | 03323 | 中国建材 | 1,013,389.15 | 114.91 |
| 35 | 000858 | 五 粮 液 | 1,005,967.00 | 114.07 |
| 36 | 300168 | 万达信息 | 1,001,068.00 | 113.52 |
| 37 | 600977 | 中国电影 | 963,117.88 | 109.21 |
| 38 | 000977 | 浪潮信息 | 956,861.00 | 108.50 |
| 39 | 03377 | 远洋集团 | 945,753.31 | 107.24 |
| 40 | 600718 | 东软集团 | 922,659.82 | 104.63 |
| 41 | 03888 | 金山软件 | 892,062.63 | 101.16 |
| 42 | 603993 | 洛阳钼业 | 887,300.00 | 100.62 |
| 43 | 02001 | 新高教集团 | 876,617.73 | 99.40 |
| 44 | 00285 | 比亚迪电子 | 866,455.38 | 98.25 |
| 45 | 600809 | 山西汾酒 | 861,786.00 | 97.72 |
| 46 | 601992 | 金隅集团 | 855,360.00 | 96.99 |
| 47 | 00895 | 东江环保 | 843,148.01 | 95.61 |
| 48 | 300498 | 温氏股份 | 836,068.00 | 94.81 |
| 49 | 002508 | 老板电器 | 796,256.00 | 90.29 |
| 50 | 601009 | 南京银行 | 789,445.00 | 89.52 |
| 51 | 600196 | 复星医药 | 789,416.00 | 89.52 |
| 52 | 600699 | 均胜电子 | 786,010.00 | 89.13 |
| 53 | 600622 | 光大嘉宝 | 710,467.00 | 80.56 |
| 54 | 002127 | 南极电商 | 708,661.00 | 80.36 |
| 55 | 002384 | 东山精密 | 703,745.00 | 79.80 |
| 56 | 01234 | 中国利郎 | 684,902.28 | 77.67 |
| 57 | 600887 | 伊利股份 | 677,687.00 | 76.85 |
| 58 | 01970 | IMAX CHINA | 671,346.93 | 76.13 |
| 59 | 00665 | 海通国际 | 656,861.96 | 74.49 |
| 60 | 600029 | 南方航空 | 656,040.00 | 74.39 |
| 61 | 00337 | 绿地香港 | 653,381.31 | 74.09 |
| 62 | 300770 | 新媒股份 | 630,420.00 | 71.49 |
| 63 | 600373 | 中文传媒 | 628,398.00 | 71.26 |
| 64 | 600060 | 海信电器 | 607,483.00 | 68.89 |
| 65 | 601998 | 中信银行 | 603,000.00 | 68.38 |
| 66 | 03383 | 雅居乐集团 | 599,651.46 | 68.00 |
| 67 | 01347 | 华虹半导体 | 595,299.78 | 67.50 |
| 68 | 300454 | 深信服 | 562,749.20 | 63.81 |
| 69 | 02388 | 中银香港 | 559,363.85 | 63.43 |
| 70 | 601328 | 交通银行 | 553,520.00 | 62.77 |
| 71 | 02628 | 中国人寿 | 548,170.10 | 62.16 |
| 72 | 002847 | 盐津铺子 | 540,078.00 | 61.24 |
| 73 | 000915 | 山大华特 | 537,681.00 | 60.97 |
| 74 | 00354 | 中国软件国际 | 532,182.55 | 60.35 |
| 75 | 03311 | 中国建筑国际 | 517,098.63 | 58.64 |
| 76 | 603357 | 设计总院 | 492,200.00 | 55.81 |
| 77 | 600426 | 华鲁恒升 | 491,803.00 | 55.77 |
| 78 | 00011 | 恒生银行 | 488,397.91 | 55.38 |
| 79 | 000100 | TCL集团 | 457,660.00 | 51.90 |
| 80 | 600325 | 华发股份 | 449,500.00 | 50.97 |
| 81 | 000560 | 我爱我家 | 444,161.80 | 50.37 |
| 82 | 03933 | 联邦制药 | 440,404.55 | 49.94 |
| 83 | 601012 | 隆基股份 | 433,120.00 | 49.11 |
| 84 | 00384 | 中国燃气 | 423,194.13 | 47.99 |
| 85 | 01313 | 华润水泥控股 | 420,716.34 | 47.71 |
| 86 | 600050 | 中国联通 | 414,000.00 | 46.95 |
| 87 | 600585 | 海螺水泥 | 410,000.00 | 46.49 |
| 88 | 02238 | 广汽集团 | 406,773.71 | 46.13 |
| 89 | 03618 | 重庆农村商业银行 | 406,263.56 | 46.07 |
| 90 | 601336 | 新华保险 | 405,748.25 | 46.01 |
| 91 | 002572 | 索菲亚 | 404,778.00 | 45.90 |
| 92 | 00189 | 东岳集团 | 404,400.36 | 45.86 |
| 93 | 06030 | 中信证券 | 396,328.00 | 44.94 |
| 94 | 00119 | 保利置业集团 | 392,247.51 | 44.48 |
| 95 | 601111 | 中国国航 | 387,180.00 | 43.90 |
| 96 | 01999 | 敏华控股 | 374,796.64 | 42.50 |
| 97 | 601001 | 大同煤业 | 370,918.00 | 42.06 |
| 98 | 600312 | 平高电气 | 369,600.00 | 41.91 |
| 99 | 600115 | 东方航空 | 363,555.00 | 41.23 |
| 100 | 601288 | 农业银行 | 362,500.00 | 41.11 |
| 101 | 002174 | 游族网络 | 359,035.00 | 40.71 |
| 102 | 000423 | 东阿阿胶 | 350,600.00 | 39.76 |
| 103 | 00175 | 吉利汽车 | 345,676.45 | 39.20 |
| 104 | 601899 | 紫金矿业 | 344,000.00 | 39.01 |
| 105 | 601318 | 中国平安 | 338,984.00 | 38.44 |
| 106 | 01569 | 民生教育 | 333,622.13 | 37.83 |
| 107 | 603369 | 今世缘 | 330,723.00 | 37.50 |
| 108 | 002463 | 沪电股份 | 321,000.00 | 36.40 |
| 109 | 01610 | 中粮肉食 | 301,008.36 | 34.13 |
| 110 | 02233 | 西部水泥 | 300,977.28 | 34.13 |
| 111 | 002142 | 宁波银行 | 299,260.00 | 33.93 |
| 112 | 002468 | 申通快递 | 291,337.00 | 33.04 |
| 113 | 002234 | 民和股份 | 290,568.00 | 32.95 |
| 114 | 02009 | 金隅集团 | 288,981.66 | 32.77 |
| 115 | 000069 | 华侨城A | 288,400.00 | 32.70 |
| 116 | 300474 | 景嘉微 | 282,128.00 | 31.99 |
| 117 | 002456 | 欧菲光 | 268,529.00 | 30.45 |
| 118 | 300207 | 欣旺达 | 267,800.00 | 30.37 |
| 119 | 300003 | 乐普医疗 | 266,270.00 | 30.19 |
| 120 | 01888 | 建滔积层板 | 261,778.32 | 29.68 |
| 121 | 01788 | 国泰君安国际 | 261,134.28 | 29.61 |
| 122 | 000088 | 盐 田 港 | 260,533.00 | 29.54 |
| 123 | 603713 | 密尔克卫 | 256,717.00 | 29.11 |
| 124 | 00753 | 中国国航 | 245,733.74 | 27.87 |
| 125 | 00998 | 中信银行 | 243,497.83 | 27.61 |
| 126 | 03339 | 中国龙工 | 240,650.01 | 27.29 |
| 127 | 000333 | 美的集团 | 238,800.00 | 27.08 |
| 128 | 01658 | 邮储银行 | 236,717.83 | 26.84 |
| 129 | 300568 | 星源材质 | 227,131.00 | 25.76 |
| 130 | 02357 | 中航科工 | 226,752.55 | 25.71 |
| 131 | 02018 | 瑞声科技 | 226,014.45 | 25.63 |
| 132 | 002129 | 中环股份 | 221,980.00 | 25.17 |
| 133 | 01238 | 宝龙地产 | 213,071.80 | 24.16 |
| 134 | 00390 | 中国中铁 | 207,603.89 | 23.54 |
| 135 | 601021 | 春秋航空 | 202,627.00 | 22.98 |
| 136 | 02318 | 中国平安 | 196,899.02 | 22.33 |
| 137 | 002233 | 塔牌集团 | 192,320.00 | 21.81 |
| 138 | 600989 | 宝丰能源 | 191,140.00 | 21.67 |
| 139 | 600038 | 中直股份 | 189,621.00 | 21.50 |
| 140 | 02333 | 长城汽车 | 182,649.21 | 20.71 |
| 141 | 03380 | 龙光地产 | 181,763.00 | 20.61 |
| 142 | 03808 | 中国重汽 | 170,302.16 | 19.31 |
| 143 | 601233 | 桐昆股份 | 168,600.00 | 19.12 |
| 144 | 600004 | 白云机场 | 165,490.00 | 18.77 |
| 145 | 601988 | 中国银行 | 163,400.00 | 18.53 |
| 146 | 03908 | 中金公司 | 161,318.53 | 18.29 |
| 147 | 01093 | 石药集团 | 158,606.99 | 17.99 |
| 148 | 600845 | 宝信软件 | 153,908.00 | 17.45 |
| 149 | 01988 | 民生银行 | 151,733.79 | 17.21 |
| 150 | 603583 | 捷昌驱动 | 141,727.12 | 16.07 |
| 151 | 01072 | 东方电气 | 141,360.56 | 16.03 |
| 152 | 601088 | 中国神华 | 141,158.00 | 16.01 |
| 153 | 01963 | 重庆银行 | 139,422.32 | 15.81 |
| 154 | 00867 | 康哲药业 | 135,997.24 | 15.42 |
| 155 | 000876 | 新 希 望 | 130,800.00 | 14.83 |
| 156 | 06818 | 中国光大银行 | 128,325.94 | 14.55 |
| 157 | 600104 | 上汽集团 | 123,810.00 | 14.04 |
| 158 | 002366 | 台海核电 | 123,200.00 | 13.97 |
| 159 | 002507 | 涪陵榨菜 | 121,978.00 | 13.83 |
| 160 | 00751 | 创维数码 | 104,589.38 | 11.86 |
| 161 | 00590 | 六福集团 | 96,251.39 | 10.91 |
| 162 | 01458 | 周黑鸭 | 90,780.90 | 10.29 |
| 163 | 02601 | 中国太保 | 87,388.51 | 9.91 |
| 164 | 000776 | 广发证券 | 81,500.00 | 9.24 |
| 165 | 000783 | 长江证券 | 76,800.00 | 8.71 |
| 166 | 02007 | 碧桂园 | 76,241.44 | 8.65 |
| 167 | 600919 | 江苏银行 | 72,300.00 | 8.20 |
| 168 | 600019 | 宝钢股份 | 68,000.00 | 7.71 |
| 169 | 001979 | 招商蛇口 | 65,610.00 | 7.44 |
| 170 | 002377 | 国创高新 | 65,000.00 | 7.37 |
| 171 | 06837 | 海通证券 | 59,120.34 | 6.70 |
| 172 | 000166 | 申万宏源 | 55,200.00 | 6.26 |
| 173 | 02689 | 玖龙纸业 | 53,994.46 | 6.12 |
| 174 | 601898 | 中煤能源 | 48,300.00 | 5.48 |
| 175 | 002955 | 鸿合科技 | 45,478.88 | 5.16 |
| 176 | 002008 | 大族激光 | 42,140.00 | 4.78 |
| 177 | 002024 | 苏宁易购 | 41,010.00 | 4.65 |
| 178 | 01030 | 新城发展控股 | 40,822.39 | 4.63 |
| 179 | 02799 | 中国华融 | 39,038.40 | 4.43 |
| 180 | 02777 | 富力地产 | 38,052.90 | 4.32 |
| 181 | 000600 | 建投能源 | 34,366.00 | 3.90 |
| 182 | 603068 | 博通集成 | 33,702.00 | 3.82 |
| 183 | 02328 | 中国财险 | 33,358.05 | 3.78 |
| 184 | 601166 | 兴业银行 | 31,040.00 | 3.52 |
| 185 | 00884 | 旭辉控股集团 | 27,855.17 | 3.16 |
| 186 | 03968 | 招商银行 | 26,849.74 | 3.04 |
| 187 | 00257 | 中国光大国际 | 26,226.19 | 2.97 |
| 188 | 603317 | 天味食品 | 25,102.00 | 2.85 |
| 189 | 603327 | 福蓉科技 | 24,837.12 | 2.82 |
| 190 | 603982 | 泉峰汽车 | 24,718.82 | 2.80 |
| 191 | 002191 | 劲嘉股份 | 21,816.00 | 2.47 |
| 192 | 300777 | 中简科技 | 20,584.22 | 2.33 |
| 193 | 03898 | 中车时代电气 | 19,107.22 | 2.17 |
| 194 | 00696 | 中国民航信息网络 | 19,063.99 | 2.16 |
| 195 | 603217 | 元利科技 | 17,655.84 | 2.00 |

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 | 128,171,203.36 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 108,299,759.86 |

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前十名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

| 代 码 | 名 称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元) | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| IC1907 | IC1907 | 1 | 981,280.00 | -8,200.00 | - |
| IF1907 | IF1907 | 1 | 1,141,500.00 | 15,240.00 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | 7,040.00 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | 7,861.94 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | 7,040.00 |

7.10.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

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

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2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

注：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

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

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 | 348,761.44 |
| 2 | 应收证券清算款 | 577,245.87 |
| 3 | 应收股利 | 28,800.00 |
| 4 | 应收利息 | 1,286.13 |
| 5 | 应收申购款 | 43,678.07 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 999,771.51 |

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

注：无。

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

| 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（%） |
| 2,154 | 8,608.92 | 808,794.29 | 4.36 | 17,734,825.89 | 95.64 |

8.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 146,024.51 | 0.7875 |

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。

8.3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

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

注：截至本报告期末，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。

### §9开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（2016年12月2日）基金份额总额 | 430,388,068.84 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 727,592.28 |
| 本报告期基金总申购份额 | 50,559,105.86 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 32,743,077.96 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 18,543,620.18 |

注：总申购份额含红利再投。

### §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，基金管理人无重大人事变动。

托管人中国建设银行2019年6月4日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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 | |
| 银河证券 | 2 | 131,111,397.80 | 55.54% | 127,335.77 | 57.10% | - |
| 天风证券 | 1 | 29,855,232.09 | 12.65% | 27,208.00 | 12.20% | - |
| 广发证券 | 2 | 24,170,195.93 | 10.24% | 22,026.27 | 9.88% | - |
| 中投证券 | 1 | 20,214,709.78 | 8.56% | 18,421.34 | 8.26% | - |
| 方正证券 | 2 | 10,989,882.35 | 4.66% | 10,014.93 | 4.49% | - |
| 兴业证券 | 3 | 7,197,636.95 | 3.05% | 6,559.21 | 2.94% | 本报告期新增1个 |
| 长江证券 | 1 | 3,894,162.00 | 1.65% | 3,548.84 | 1.59% | - |
| 瑞信方正 | 1 | 3,529,790.00 | 1.50% | 3,216.73 | 1.44% | - |
| 华泰证券 | 1 | 3,167,903.88 | 1.34% | 2,886.86 | 1.29% | - |
| 平安证券 | 2 | 1,942,682.12 | 0.82% | 1,770.25 | 0.79% | - |
| 西部证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方财富证券 | 1 | - | - | - | - | 本报告期内注销1个 |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广州证券 | 1 | - | - | - | - | 本报告期新增 |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东莞证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |

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

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 银河证券 | 8,700.80 | 1.27% | - | - | - | - |
| 天风证券 | 629,742.60 | 92.18% | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 28,708.19 | 4.20% | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞信方正 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 16,044.00 | 2.35% | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方财富证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东莞证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广州证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |

### §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。 |

鹏华基金管理有限公司
2019年8月23日