

鹏华新兴产业混合型证券投资基金 2019 年 半年度报告

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：招商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 23 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。

基金托管人招商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。

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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
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	11
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度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	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
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	37
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	38

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	38
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	38
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	38
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.12	投资组合报告附注	38
§ 8	基金份额持有人信息	41
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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	41
§ 9	开放式基金份额变动	41
§ 10	重大事件揭示	42
10.1	基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4	基金投资策略的改变	42
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8	其他重大事件	44
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12	备查文件目录	50
12.1	备查文件目录	50
12.2	存放地点	50
12.3	查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华新兴产业混合型证券投资基金
基金简称	鹏华新兴产业混合
基金主代码	206009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 6 月 15 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,327,927,840.45 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，挖掘未来推动经济发展的新兴产业并从中精选优质个股，力求超额收益与长期资本增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金通过对宏观经济、微观经济运行态势、政策环境、利率走势、证券市场走势及证券市场现阶段的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，运用定量及定性相结合的手段，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 本基金通过跟踪、分析经济运行态势、经济政策以及产业结构的优化升级，识别经济发展过程中具有良好发展前景的新兴产业及相关上市公司，针对各类公司的不同特征，通过自上而下及自下而上相结合的方法筛选出优秀的上市公司构建投资组合。3、债券投资策略 本基金通过久期配置、类属配置、期限结构配置等，采取积极主动的投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现债券组合增值。4、权证产品投资策略 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。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%
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型基金、债券基金，低于股票型基金，为证券投资基金中具有中高风险、中高收益的投资品种。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张戈	张燕
	联系电话	0755-82825720	0755-83199084
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006788999	95555
传真		0755-82021126	0755-83195201

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	深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518048	518040
法定代表人	何如	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鹏华基金管理有限公司	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

§ 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	128,818,223.32
本期利润	459,418,949.91
加权平均基金份额本期利润	0.3427
本期加权平均净值利润率	16.65%
本期基金份额净值增长率	21.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	970,734,599.04
期末可供分配基金份额利润	0.7310
期末基金资产净值	2,840,189,946.30
期末基金份额净值	2.139
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	151.89%

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

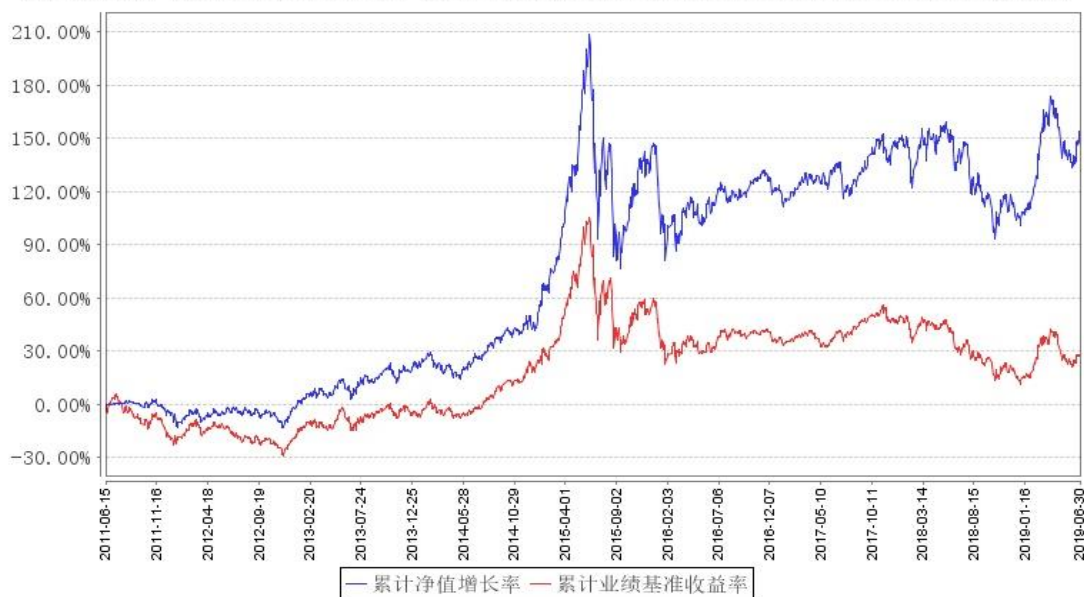
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.29%	1.19%	2.78%	0.91%	1.51%	0.28%
过去三个月	-4.68%	1.58%	-6.82%	1.26%	2.14%	0.32%
过去六个月	21.95%	1.47%	12.36%	1.28%	9.59%	0.19%
过去一年	3.05%	1.44%	-3.93%	1.24%	6.98%	0.20%
过去三年	16.04%	1.15%	-5.23%	0.95%	21.27%	0.20%
自基金成立起至今	151.89%	1.42%	27.63%	1.27%	124.26%	0.15%

注：业绩比较基准=中证新兴产业指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%

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

鹏华新兴产业混合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 2011 年 06 月 15 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		
梁浩	本基金基金经理	2011-07-14	-	11	梁浩先生,国籍中国,经济学博士,11

				<p>年证券投资基金从业经验。曾任职于信息产业部电信研究院，从事产业政策研究工作；2008年5月加盟鹏华基金管理有限公司，从事研究分析工作，历任研究部高级研究员、基金经理助理，现同时担任研究部总经理、投资决策委员会成员。</p> <p>2011年07月担任鹏华新兴产业混合基金基金经理，2014年03月至2015年12月担任鹏华环保产业股票基金基金经理，2014年11月至2015年12月担任鹏华先进制造股票基金基金经理，2015年07月至2017年03月担任鹏华动力增长混合（LOF）基金基金经理，2016年01月至2017年03月担任鹏华健康环保混合基金基金经理，2016年06月至2017年07月担任鹏华医药科技股票基金基金经理，2017年10月担任鹏华研究精选混合基金基金经理，2018年06月担任鹏华创新驱动混合基金基金经理，2018年09月担任鹏华研究驱动混合基金基金经理，2019年05月担任鹏华研究智选混合基金基金经理。梁浩先生具备基金从业资</p>
--	--	--	--	---

					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

二季度,受中美贸易战有所反复的影响,科技类股票普遍出现较大幅度下跌。组合中的公司虽然整体受中美贸易战影响不大,但也受到市场情绪影响,出现一定程度回撤。

我们仍然坚持精选个股的方针,二季度,我们在医药类公司适度增加了配置。对一些前期涨幅较高,估值已经较贵的公司做了一些获利了结。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

鹏华新兴产业混合组合净值增长率 21.95%;业绩比较基准增长率 12.36%。同期上证综指涨跌幅为 19.4468%,深证成指涨跌幅为 26.7760%,沪深 300 指数涨跌幅为 27.0683%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从近期经济数据看,一季度的高额社融对经济的支撑正在减弱,经济增速进一步稳中趋缓。我们认为,市场将进入业绩驱动的结构行情。

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

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 970,734,599.04 元，期末基金份额净值 2.139 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

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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：鹏华新兴产业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	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	586,735,802.39	518,780,020.02
结算备付金		1,527,670.96	1,319,825.95
存出保证金		953,072.76	706,292.70

交易性金融资产	6.4.7.2	2,305,569,911.88	1,582,226,859.56
其中：股票投资		2,305,569,911.88	1,581,124,961.06
基金投资		-	-
债券投资		-	1,101,898.50
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	131,798.69	117,101.81
应收股利		-	-
应收申购款		1,940,962.62	430,605.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,896,859,219.30	2,103,580,705.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	6,200,148.78
应付赎回款		50,246,987.24	618,993.45
应付管理人报酬		3,551,755.73	2,673,022.65
应付托管费		591,959.27	445,503.78
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,851,764.25	1,434,071.33
应交税费		-	11.46
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	426,806.51	402,060.05
负债合计		56,669,273.00	11,773,811.50
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,327,927,840.45	1,192,743,371.95
未分配利润	6.4.7.10	1,512,262,105.85	899,063,522.34
所有者权益合计		2,840,189,946.30	2,091,806,894.29
负债和所有者权益总计		2,896,859,219.30	2,103,580,705.79

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.139 元，基金份额总额 1,327,927,840.45 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华新兴产业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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		489,119,121.20	-6,645,408.29
1. 利息收入		2,415,151.20	1,004,557.97
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,413,976.91	1,003,755.54
债券利息收入		1,174.29	802.43
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		154,706,145.53	-13,899,045.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	137,721,475.08	-20,935,526.00
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	139,738.63	-
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	16,844,931.82	7,036,480.82
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	330,600,726.59	5,982,452.32
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	1,397,097.88	266,626.60
减：二、费用		29,700,171.29	13,049,314.39
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	20,432,860.41	9,342,006.33
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,405,476.68	1,557,001.10
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,725,495.05	1,942,195.68
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		4.21	2.81
7. 其他费用	6.4.7.20	136,334.94	208,108.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		459,418,949.91	-19,694,722.68

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		459,418,949.91	-19,694,722.68

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华新兴产业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 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）	1,192,743,371.95	899,063,522.34	2,091,806,894.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	459,418,949.91	459,418,949.91
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）	135,184,468.50	153,779,633.60	288,964,102.10
其中：1. 基金申购款	665,824,130.80	750,797,408.69	1,416,621,539.49
2. 基金赎回款	-530,639,662.30	-597,017,775.09	-1,127,657,437.39
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）	1,327,927,840.45	1,512,262,105.85	2,840,189,946.30
项目	上年度可比期间 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）	427,641,331.61	556,364,180.86	984,005,512.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期	-	-19,694,722.68	-19,694,722.68

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)	327,898,919.69	421,514,947.07	749,413,866.76
其中：1. 基金申购款	463,617,608.77	599,631,338.80	1,063,248,947.57
2. 基金赎回款	-135,718,689.08	-178,116,391.73	-313,835,080.81
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)	755,540,251.30	958,184,405.25	1,713,724,656.55

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

鹏华新兴产业混合型证券投资基金(原名鹏华新兴产业股票型证券投资基金,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[2011]602号《关于核准鹏华新兴产业股票型证券投资基金募集的批复》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《鹏华新兴产业股票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1,360,809,713.38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(2011)第209号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华新兴产业股票型证券投资基金基金合同》于2011年6月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,361,139,361.80份基金份额,其中认购资金利息折合329,648.42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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

为符合2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》中关于不同基金类别所

适用投资比例的规定，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及相关基金合同的有关规定，经协商相关基金托管人同意，并报中国证监会备案，鹏华基金管理有限公司决定自 2015 年 8 月 3 日起，将“鹏华新兴产业股票型证券投资基金”更名为“鹏华新兴产业混合型证券投资基金”，基金类别由股票型证券投资基金变更为混合型证券投资基金，并相应修订基金合同部分条款。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华新兴产业股票型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，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。本基金的投资组合中股票资产占基金资产的 60%–95%，其中投资于新兴产业相关的股票占股票资产的比例不低于 80%，债券、货币市场工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他资产不高于基金资产的 40%，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；基金保留的现金以及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。本基金的业绩比较基准为：中证新兴产业指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%。

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》、《鹏华新兴产业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。

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 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

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

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[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 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 2019年6月30日
活期存款	586,735,802.39
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	586,735,802.39

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,056,505,486.28	2,305,569,911.88	249,064,425.60
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	2,056,505,486.28	2,305,569,911.88	249,064,425.60

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 2019年6月30日
应收活期存款利息	130,682.29
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	687.50
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	-
其他	428.90
合计	131,798.69

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 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,851,764.25
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,851,764.25

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	102,973.43
预提费用	323,833.08
合计	426,806.51

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,192,743,371.95	1,192,743,371.95
本期申购	665,824,130.80	665,824,130.80
本期赎回（以“-”号填列）	-530,639,662.30	-530,639,662.30
- 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	1,327,927,840.45	1,327,927,840.45

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

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	758,649,163.77	140,414,358.57	899,063,522.34
本期利润	128,818,223.32	330,600,726.59	459,418,949.91
本期基金份额交易产生的变动数	83,267,211.95	70,512,421.65	153,779,633.60
其中：基金申购款	451,483,283.87	299,314,124.82	750,797,408.69
基金赎回款	-368,216,071.92	-228,801,703.17	-597,017,775.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	970,734,599.04	541,527,506.81	1,512,262,105.85

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	2,348,768.96
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	30,559.91
其他	34,648.04
合计	2,413,976.91

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	1,852,538,590.06
减：卖出股票成本总额	1,714,817,114.98
买卖股票差价收入	137,721,475.08

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

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	139,738.63
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	139,738.63

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,182,506.90
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,041,000.00
减：应收利息总额	1,768.27
买卖债券差价收入	139,738.63

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
	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	16,844,931.82
基金投资产生的股利收益	-
合计	16,844,931.82

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	330,600,726.59
股票投资	330,661,625.09
债券投资	-60,898.50
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	330,600,726.59

6.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	1,390,614.59
基金转换费收入	6,483.29

合计	1,397,097.88
----	--------------

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	5,725,495.05
银行间市场交易费用	-
合计	5,725,495.05

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	74,244.51
银行汇划费用	12,501.86
合计	136,334.94

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

无。

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、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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

注:无。

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

注:无。

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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 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	20,432,860.41	9,342,006.33
其中:支付销售机构的客户维护费	2,999,129.67	2,097,122.77

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1.5%，逐日计提，按月支付。

日管理费=前一日基金资产净值×1.5%÷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	上年度可比期间
----	----	---------

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	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	3,405,476.68	1,557,001.10

注：支付基金托管人招商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。

6.4.10.2.3 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：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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没有投资及持有本基金份额。

6.4.10.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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
招商银行	586,735,802.39	2,348,768.96	469,832,254.81	930,131.34

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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(2019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
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年07月05日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

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

注：无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

本基金为混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。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约责任，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招商银行股份有限公司，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 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2018 年 12 月 31 日：0.05%）。

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、组合在短期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在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,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。本基金所持有的全部金融负债的合约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期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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组

合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。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。综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，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 2019 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	586,735,802.39	-	-	-	586,735,802.39
结算备付金	1,527,670.96	-	-	-	1,527,670.96
存出保证金	953,072.76	-	-	-	953,072.76
交易性金融资产	-	-	-	-2,305,569,911.88	2,305,569,911.88
应收利息	-	-	-	131,798.69	131,798.69
应收申购款	-	-	-	1,940,962.62	1,940,962.62
资产总计	589,216,546.11	-	-	-2,307,642,673.19	2,896,859,219.30
负债					
应付赎回款	-	-	-	50,246,987.24	50,246,987.24
应付管理人报酬	-	-	-	3,551,755.73	3,551,755.73
应付托管费	-	-	-	591,959.27	591,959.27
应付交易费用	-	-	-	1,851,764.25	1,851,764.25
其他负债	-	-	-	426,806.51	426,806.51
负债总计	-	-	-	56,669,273.00	56,669,273.00
利率敏感度缺口	589,216,546.11	-	-	-2,250,973,400.19	2,840,189,946.30
上年度末 2018 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	518,780,020.02	-	-	-	518,780,020.02
结算备付金	1,319,825.95	-	-	-	1,319,825.95
存出保证金	706,292.70	-	-	-	706,292.70
交易性金融资产	-	1,101,898.50	-	-1,581,124,961.06	1,582,226,859.56
应收利息	-	-	-	117,101.81	117,101.81
应收申购款	-	-	-	430,605.75	430,605.75
资产总计	520,806,138.67	1,101,898.50	-	-1,581,672,668.62	2,103,580,705.79
负债					
应付赎回款	-	-	-	618,993.45	618,993.45
应付管理人报酬	-	-	-	2,673,022.65	2,673,022.65
应付托管费	-	-	-	445,503.78	445,503.78
应付证券清算款	-	-	-	6,200,148.78	6,200,148.78
应付交易费用	-	-	-	1,434,071.33	1,434,071.33
应付税费	-	-	-	11.46	11.46
其他负债	-	-	-	402,060.05	402,060.05
负债总计	-	-	-	11,773,811.50	11,773,811.50
利率敏感度缺口	520,806,138.67	1,101,898.50	-	-1,569,898,857.12	2,091,806,894.29

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 2019 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%。

(2018 年 12 月 31 日：0.05%)，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（2018 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个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。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产占基金资产的 60%—95%，其中投资于新兴产业相关的股票占股票资产的比例不低于 80%；债券、货币市场工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他资产不高于基金资产的 40%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	2,305,569,911.88	81.18	1,581,124,961.06	75.59
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—

交易性金融资产 — 债券投资	-	-	1,101,898.50	0.05
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	2,305,569,911.88	81.18	1,582,226,859.56	75.64

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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	118,672,494.97	91,403,348.34
	业绩比较基准下降5%	-118,672,494.97	-91,403,348.34

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：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	2,305,569,911.88	79.59
	其中：股票	2,305,569,911.88	79.59
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	588,263,473.35	20.31
8	其他各项资产	3,025,834.07	0.10
9	合计	2,896,859,219.30	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	56,087,550.20	1.97
B	采矿业	363,431.25	0.01
C	制造业	1,661,743,297.17	58.51
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	88,219,520.93	3.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	387,399,244.83	13.64
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	111,733,760.90	3.93
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	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,305,569,911.88	81.18

7.2.2 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

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	002705	新宝股份	19,037,407	218,930,180.50	7.71
2	002851	麦格米特	10,924,785	215,982,999.45	7.60
3	300463	迈克生物	8,084,353	203,159,790.89	7.15
4	300577	开润股份	3,488,387	122,895,874.01	4.33
5	002878	元隆雅图	4,029,603	111,700,595.16	3.93
6	300170	汉得信息	8,070,900	109,683,531.00	3.86
7	600845	宝信软件	3,586,966	102,156,791.68	3.60
8	300047	天源迪科	11,383,234	95,277,668.58	3.35
9	000661	长春高新	260,961	88,204,818.00	3.11
10	603713	密尔克卫	2,531,423	88,169,463.09	3.10
11	300558	贝达药业	1,992,815	82,701,822.50	2.91
12	603658	安图生物	1,124,858	76,895,292.88	2.71
13	002475	立讯精密	3,026,609	75,029,637.11	2.64
14	300628	亿联网络	604,592	64,733,665.44	2.28
15	000651	格力电器	1,160,200	63,811,000.00	2.25
16	603916	苏博特	4,800,878	61,931,326.20	2.18
17	300624	万兴科技	1,280,224	61,745,203.52	2.17
18	000063	中兴通讯	1,821,184	59,243,115.52	2.09
19	300630	普利制药	983,320	56,658,898.40	1.99
20	603345	安井食品	1,093,867	56,224,763.80	1.98
21	300498	温氏股份	1,564,070	56,087,550.20	1.97
22	002332	仙琚制药	8,244,175	55,730,623.00	1.96
23	603960	克来机电	1,850,103	50,489,310.87	1.78
24	300632	光莆股份	2,655,237	47,449,085.19	1.67
25	300525	博思软件	844,311	18,279,333.15	0.64
26	603338	浙江鼎力	294,500	17,290,095.00	0.61
27	002616	长青集团	2,382,808	17,275,358.00	0.61
28	002838	道恩股份	1,299,507	14,554,478.40	0.51
29	603197	保隆科技	598,340	11,506,078.20	0.41
30	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.01
31	300770	新媒股份	1,271	109,941.50	0.00
32	603267	鸿远电子	1,651	81,130.14	0.00
33	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
34	603068	博通集成	1,231	71,373.38	0.00
35	601865	福莱特	7,018	71,302.88	0.00
36	002955	鸿合科技	1,108	65,194.72	0.00
37	300773	拉卡拉	1,250	64,725.00	0.00
38	603697	有友食品	3,383	64,006.36	0.00
39	300775	三角防务	2,164	63,621.60	0.00
40	603915	国茂股份	2,523	58,710.21	0.00
41	300779	惠城环保	1,047	54,485.88	0.00
42	603967	中创物流	2,518	50,057.84	0.00

43	603317	天味食品	1,156	48,494.20	0.00
44	300777	中简科技	1,156	42,540.80	0.00
45	300768	迪普科技	1,128	42,446.64	0.00
46	603982	泉峰汽车	1,845	42,121.35	0.00
47	603681	永冠新材	1,767	40,641.00	0.00
48	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
49	603217	元利科技	584	39,268.16	0.00
50	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
51	300772	运达股份	2,336	37,095.68	0.00
52	603327	福蓉科技	1,323	34,014.33	0.00
53	300781	因赛集团	727	33,165.74	0.00
54	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
55	300780	德恩精工	935	27,676.00	0.00
56	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
57	002953	日丰股份	1,072	26,499.84	0.00
58	300788	中信出版	1,556	23,106.60	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	300463	迈克生物	178,936,186.62	8.55
2	002624	完美世界	113,898,268.22	5.44
3	603713	密尔克卫	99,942,803.51	4.78
4	002705	新宝股份	91,306,137.96	4.36
5	603916	苏博特	88,926,606.62	4.25
6	600845	宝信软件	88,835,506.52	4.25
7	002851	麦格米特	86,151,054.15	4.12
8	000661	长春高新	76,058,819.00	3.64
9	603658	安图生物	73,834,542.36	3.53
10	000063	中兴通讯	72,255,763.83	3.45
11	300624	万兴科技	70,593,808.45	3.37
12	300349	金卡智能	66,097,952.78	3.16
13	600030	中信证券	66,003,213.68	3.16
14	000651	格力电器	64,405,357.00	3.08
15	300498	温氏股份	64,051,370.58	3.06
16	300413	芒果超媒	59,743,415.00	2.86
17	600136	当代明诚	56,766,778.58	2.71
18	002332	仙琚制药	55,295,351.54	2.64
19	600340	华夏幸福	51,114,181.87	2.44
20	300556	丝路视觉	46,836,607.30	2.24
21	603345	安井食品	45,581,897.57	2.18

22	300628	亿联网络	43,811,988.30	2.09
23	002242	九阳股份	42,618,866.39	2.04
24	300558	贝达药业	42,223,031.26	2.02

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	002624	完美世界	105,552,312.51	5.05
2	002299	圣农发展	93,634,277.15	4.48
3	600030	中信证券	92,273,670.56	4.41
4	300207	欣旺达	79,587,011.73	3.80
5	603043	广州酒家	77,519,267.17	3.71
6	000063	中兴通讯	69,408,982.57	3.32
7	600566	济川药业	63,502,194.59	3.04
8	300349	金卡智能	59,123,496.74	2.83
9	300498	温氏股份	57,634,796.56	2.76
10	300413	芒果超媒	53,605,421.49	2.56
11	600340	华夏幸福	51,283,138.00	2.45
12	002614	奥佳华	51,205,681.01	2.45
13	300556	丝路视觉	49,657,407.36	2.37
14	603345	安井食品	48,755,850.08	2.33
15	600136	当代明诚	46,683,256.57	2.23
16	002157	正邦科技	44,379,314.20	2.12
17	300628	亿联网络	43,097,196.06	2.06
18	002242	九阳股份	39,929,987.36	1.91
19	300699	光威复材	38,504,751.47	1.84
20	300326	凯利泰	38,311,610.87	1.83

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	2,108,600,440.71
卖出股票收入(成交)总额	1,852,538,590.06

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:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

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

开润股份 公司于 2018 年 4 月 19 日收到深圳证券交易所创业板公司管理部下发的《关于对安徽开润股份有限公司的监管函》(创业板监管函【2018】第 30 号), 具体内容如下:

“你公司于 2017 年 3 月 6 日召开 2017 年第二次临时股东大会, 同意公司使用不超过 16,000 万元的暂时闲置募集资金进行现金管理, 使用期限自股东大会审议通过之日起不超过 12 个月。2017 年 6 月 28 日公司召开第二届董事会第一次会议和第二届监事会第一次会议, 同意公司增加使用不超过 3,500 万元暂时闲置募集资金进行现金管理, 使用期限自董事会审议通过之日起不超

过 12 个月。

你公司于 2018 年 3 月 22 日、2018 年 4 月 9 日分别使用闲置募集资金购买 5000 万元、7000 万元保本理财产品，超过第二届董事会第一次会议的审批额度。上述行为违反了本所《创业板股票上市规则（2014 年修订）》第 11.2.1 条、《创业板上市公司规范运作指引（2015 年修订）》第 6.3.14 条和《创业板信息披露业务备忘录第 1 号——超募资金及闲置募集资金使用》的相关规定。请你公司董事会充分重视上述问题，及时整改，吸取教训，采取切实有效措施，杜绝此类违规行为的再次发生，并将整改报告于 2018 年 4 月 25 日前报送我部。

我部提醒你公司：上市公司应当建立、健全募集资金管理制度，并确保该制度的有效实施。募集资金管理制度应当对募集资金专户存储、使用、变更、监督和责任追究等内容进行明确规定。

开润整改方案：针对上述情况，开润股份立即赎回了超过审批额度部分的理财产品，转入募集资金专户，同时召开董事会及股东大会审议通过《关于使用部分闲置募集资金进行现金管理的议案》，并提出了如下整改措施：

（1）明确责任处罚：公司对本次闲置募集资金使用的具体经办人员进行批评教育，同时组织公司财务部学习《募集资金管理办法》。

（2）强化内控管理：进一步修订完善公司的资金管理制度和《募集资金管理办法》，增加募集资金使用的审批环节和风险控制环节，细化操作流程，严格审批程序，堵塞监管漏洞。

（3）强化合规意识：组织公司相关部门负责人及具体经办人员认真学习相关证券监管法规和规章制度，认真领悟《募集资金管理办法》，增强合规意识、责任意识和风险意识。

公司对本次募集资金过程中出现的违规问题进行了严肃的反思和检讨，并进行相应的完善和整改，公司今后将着力提升公司治理水平，严格按照募集资金相关办法对募集资金进行谨慎规范的管理，避免此类违规行为的发生。

经自查，除上述情况外，最近五年内公司不存在其他被证券监管部门和证券交易所采取监管措施或处罚的情况。

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。上述通告对该公司股票的投资价值不产生重大影响，该证券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。

济川药业 本次公告原因为泰州环保局对公司进行全面检查，公司收到泰州市环境保护局（以

下简称“泰州环保局”)出具的《泰州市环境保护局行政处罚决定书(泰环罚字[2018]2-335号)》,泰州市环保局根据《中华人民共和国大气污染防治法》第十八条和第四十五条的规定,判断公司未采取有效措施防治含挥发性有机物废气、废气超标排放的违法行为。鉴于济川有限积极改正环境违法行为,且情节轻微,根据相关规定中关于从轻行政处罚的情形,泰州环保局作出对济川有限未采取有效措施防治含挥发性有机物废气的行为罚款8万元,对废气超标排放的行为罚款10万元的处罚决定。济川有限收到《责令改正违法行为决定书》后高度重视,立即进行了整改并委托江苏泰洁检测技术有限公司常州分公司进行了相关结果检测,根据其2018年7月17日出具的《检测报告(TCH(2018)1066号)》,开发区分厂污水处理设施废气处理装置排放口非甲烷总烃的排放浓度和排放速率均符合国家相关标准。2018年7月31日,泰州环保局针对整改情况进行了进一步检查,根据《泰兴市环境监测站监测报告(环监(气)字(2018)第(089)号)》,上述排放口的非甲烷总烃排放浓度符合国家标准要求。另外,针对中药车间两套乙醇回收装置的不凝性尾气经收集后未使用污染防治设施直接高空排放以及两个车间出渣室无组织废气未收集处理,济川有限已于2018年8月31日前完成相关处理设施的安装调试工作。今后公司将进一步加强日常管理,合规地开展各项业务。目前,公司的经营情况正常。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。上述通告对该公司股票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。

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	953,072.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	131,798.69
5	应收申购款	1,940,962.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,025,834.07

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 (%)
111,133	11,949.00	816,306,901.00	61.47	511,620,939.45	38.53

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	2,560,343.30	0.1928

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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注:1、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。

2、截至本报告期末,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

基金合同生效日 (2011 年 6 月 15 日) 基金份额总额	1,361,139,361.80
本报告期期初基金份额总额	1,192,743,371.95
本报告期基金总申购份额	665,824,130.80
减:本报告期基金总赎回份额	530,639,662.30

本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	1,327,927,840.45

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 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。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

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	
中泰证券	2	1,161,581,898.48	29.34%	1,058,552.83	30.06%	-
爱建证券	1	479,919,155.41	12.12%	389,360.01	11.06%	-
东北证券	1	460,642,083.24	11.63%	419,794.32	11.92%	-

西南证券	2	416,003,150.59	10.51%	379,099.42	10.76%	-
广发证券	1	375,916,973.49	9.49%	342,574.15	9.73%	-
安信证券	2	317,882,667.43	8.03%	289,687.93	8.23%	-
国盛证券	2	176,713,850.32	4.46%	143,367.31	4.07%	本报告期新增
天风证券	1	138,307,498.01	3.49%	126,039.84	3.58%	-
山西证券	1	131,747,097.37	3.33%	106,886.22	3.04%	-
招商证券	1	115,833,518.72	2.93%	105,561.51	3.00%	-
国金证券	1	80,861,770.99	2.04%	73,692.10	2.09%	-
东方财富证券	1	74,805,809.43	1.89%	60,693.17	1.72%	-
浙商证券	1	25,803,031.26	0.65%	23,514.72	0.67%	-
方正证券	1	3,214,614.00	0.08%	2,929.56	0.08%	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	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,并能为本基金提供全面的信息服;
- (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
中泰证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	1,182,506.90	100.00%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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增加上海中正达广基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2019年01月04日
2	2018年第四季度报告	《中国证券报》	2019年01月21日

3	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在浙江金观诚基金销售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》	2019 年 01 月 22 日
4	鹏华新兴产业混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要	《中国证券报》	2019 年 01 月 25 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的提示性公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2019 年 02 月 12 日
6	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》	2019 年 02 月 26 日
7	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》	2019 年 02 月 26 日
8	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	《证券时报》	2019 年 02 月 26 日
9	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》	2019 年 03 月 01 日
10	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 01 日
11	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》	2019 年 03 月 01 日
12	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 01 日
13	关于调整鹏华新兴产业混合型证券投资基金在招商银行股份有限公司定投业务起点金额的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 06 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙商银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019 年 03 月 12 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙商银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 12 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙商银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 12 日
17	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《证券日报》	2019 年 03 月 13 日
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 13 日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019 年 03 月 13 日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京恒天明泽基金销售有限	《中国证券报》	2019 年 03 月 13 日

	公司认\申购费率优惠活动的公告		
21	鹏华基金管理有限公司关于增加首创证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019年03月22日
22	鹏华基金管理有限公司关于增加首创证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019年03月22日
23	鹏华基金管理有限公司关于增加首创证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019年03月22日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国信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》	2019年03月27日
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国信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》	2019年03月27日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国信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》	2019年03月27日
27	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国信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》	2019年03月27日
28	2018年年度报告摘要	《中国证券报》	2019年03月28日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资申购费率优惠的公告	《证券日报》	2019年03月30日
30	鹏华基金管理有限公司关于调整中国工商银行融e行个人手机银行AI投服务基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019年03月30日
31	鹏华基金管理有限公司关于调整中国工商银行融e行个人手机银行AI投服务基金申购费率优惠活动的公告	《证券日报》	2019年03月30日
32	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资申购费率优惠的公告	《中国证券报》	2019年03月30日
33	鹏华基金管理有限公司关于调整中国工商银行融e行个人手机银行AI投服务基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019年03月30日

34	鹏华基金管理有限公司关于调整中国工商银行融e行个人手机银行AI投服务基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019年03月30日
35	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资申购费率优惠的公告	《上海证券报》	2019年03月30日
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资申购费率优惠的公告	《证券时报》	2019年03月30日
37	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	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2019年04月08日
38	鹏华基金管理有限公司关于增加北京唐鼎耀华基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2019年04月11日
39	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	《证券时报》	2019年04月13日
40	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》	2019年04月13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	《中国证券报》	2019年04月13日
42	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	《证券日报》	2019年04月13日
43	2019年第一季度报告	《中国证券报》	2019年04月19日
44	鹏华基金管理有限公司关于增加国盛证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019年04月30日
45	鹏华基金管理有限公司关于增加国盛证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019年04月30日
46	鹏华基金管理有限公司关于增加国盛证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019年04月30日
47	鹏华基金管理有限公司关于增加国盛证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券日报》	2019年04月30日
48	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	《中国证券报》	2019年05月07日

	示性公告		
49	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	《证券日报》	2019 年 05 月 07 日
50	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》	2019 年 05 月 07 日
51	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	《证券时报》	2019 年 05 月 07 日
52	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中泰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》	2019 年 05 月 10 日
53	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	《证券时报》	2019 年 05 月 13 日
54	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	《证券日报》	2019 年 05 月 13 日
55	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	《上海证券报》	2019 年 05 月 13 日
56	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	《中国证券报》	2019 年 05 月 13 日
57	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的提示性公告	《证券时报》	2019 年 05 月 18 日
58	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》	2019 年 05 月 18 日
59	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》	2019 年 05 月 18 日
60	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的提示性公告	《证券日报》	2019 年 05 月 18 日
61	鹏华基金管理有限公司关于北京恒天明泽基金销售有限公司终止销售本公司旗下部分基金的公告	《证券日报》	2019 年 05 月 22 日
62	鹏华基金管理有限公司关于增加国金证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 05 月 28 日

63	鹏华基金管理有限公司关于增加国金证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019 年 05 月 28 日
64	鹏华基金管理有限公司关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 06 月 06 日
65	鹏华基金管理有限公司关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 06 月 06 日
66	鹏华基金管理有限公司关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券日报》	2019 年 06 月 06 日
67	鹏华基金管理有限公司关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019 年 06 月 06 日
68	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《证券时报》	2019 年 06 月 20 日
69	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《中国证券报》	2019 年 06 月 20 日
70	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《证券日报》	2019 年 06 月 20 日
71	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《上海证券报》	2019 年 06 月 20 日
72	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》	2019 年 06 月 24 日
73	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 06 月 24 日
74	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019 年 06 月 24 日
75	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019 年 06 月 24 日
76	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的提示性公告	《证券日报》	2019 年 06 月 26 日
77	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的提示	《中国证券报》	2019 年 06 月 26 日

	性公告		
78	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》	2019 年 06 月 26 日
79	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的提示性公告	《证券时报》	2019 年 06 月 26 日
80	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019 年 06 月 27 日
81	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《证券日报》	2019 年 06 月 27 日
82	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 06 月 27 日
83	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019 年 06 月 27 日

§ 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

注:无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华新兴产业混合型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华新兴产业混合型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华新兴产业混合型证券投资基金 2019 年半年度报告》（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 43 层鹏华基金管理有限公司

深圳深南大道 7088 号招商银行大厦招商银行股份有限公司

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>）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

2019 年 8 月 23 日