(上接C105版)

法定代表人:李梅
联系人:李玉婷
客户服务电话:95523/4008895523
网址:www.swhysc.com
46)首创证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座
办公地址:北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座
法定代表人:毕劲松
联系人:刘宇
客户服务电话:400-620-0620
网址:www.sczq.com.cn
47)天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦 4 楼
办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼
法定代表人:余磊
联系人:夏旻
客户服务电话:95391/4008005000
网址:www.tfzq.com
48)万联证券股份有限公司
注册地址:广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层
办公地址:广东省广州市天河区珠江东路 13 号高德置地广场 E 座 12 层
法定代表人:张建军
联系人:甘蕾
客户服务电话:4008888133
网址:www.wlzq.com.cn
49)五矿证券有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公室 47 层 01 单元
办公地址:深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公室 47 层 01 单元
法定代表人:赵立功
联系人:马国栋
客户服务电话:4001840028
网址:www.wkzq.com.cn
50)西部证券股份有限公司
注册地址:西安市新城区东新街 232 号陕西信托大厦
办公地址:西安市新城区东新街 232 号陕西信托大厦 16-17 层
法定代表人:刘建武
联系人:梁承华
客户服务电话:95582
网址:www.westsecu.com
51)西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北区桥北苑 8 号
办公地址:重庆市江北区桥北苑 8 号
法定代表人:廖庆轩
联系人:周青
客户服务电话:4008096096/95355
网址:www.swsc.com.cn
52)湘财证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼
办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼
法定代表人:孙永祥
联系人:李欣
客户服务电话:95351
网址:www.xcsc.com
53)新时代证券股份有限公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501
办公地址:北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501
法定代表人:叶顺德
联系人:田芳芳
客户服务电话:95399
网址:www.xsdzq.cn
54)信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼
法定代表人:张志刚
联系人:尹旭航
客户服务电话:95321
网址:www.cindasc.com
55)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路 268 号
办公地址:上海市浦东新区长柳路 36 号
法定代表人:杨华辉
联系人:乔琳雪
客户服务电话:95562
网址:www.xyzq.com.cn
56)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层
法定代表人:宫少林
联系人:林生迎
客户服务电话:95565
网址:www.newone.com.cn
57)浙商证券股份有限公司
注册地址:浙江省杭州市西湖区杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座
办公地址:杭州市江干区五星路 201 号浙商证券大楼 8 楼
法定代表人:吴承根
联系人:陈姗姗
客户服务电话:95345
网址:www.stocke.com.cn
58)中国国际金融股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
法定代表人:毕明建(代)
联系人:杨涵宇
客户服务电话:4009101166
网址:www.cicc.com.cn
59)中国民族证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 40-43 层
办公地址:北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼
法定代表人:何亚刚
联系人:胡创
客户服务电话:40088-95618
网址:www.e5618.com
60)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层
办公地址:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
法定代表人:陈共炎
联系人:辛国政
客户服务电话:4008-888-888/95551
网址:www.chinastock.com.cn
61)中国中投证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元
办公地址:深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层
法定代表人:高涛
联系人:万玉琳
客户服务电话:95532/4006008008
网址:www.china-invs.cn
62)中航证券有限公司
注册地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼
办公地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼
法定代表人:王宜四
联系人:何志华
客户服务电话:95335
网址:www.avicsec.com
63)中山证券有限责任公司
注册地址:深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层
办公地址:深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层
法定代表人:林炳城
联系人:罗艺琳
客户服务电话:95329
网址:www.zszq.com
64)中泰证券股份有限公司
注册地址:济南市市中区经七路 86 号
办公地址:上海市花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层
法定代表人:李玮
联系人:朱琴
客户服务电话:95538
网址:www.zts.com.cn
65)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街 188 号
法定代表人:王常青
联系人:刘畅
客户服务电话:95587/4008-888-108
网址:www.csc108.com
66)中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦
法定代表人:张佑君
联系人:郑慧
客户服务电话:95548
网址:www.cs.ecitic.com
67)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001
办公地址:青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层
法定代表人:姜晓林
联系人:刘晓明
客户服务电话:95548
网址:http://sd.citics.com
(3)期货公司销售机构
1)中信建投期货有限公司
注册地址:重庆市渝中区中山三路 107 号上站大楼平街 11-B,名义层 11-A,8-B4,9-B、C
办公地址:重庆市渝中区中山三路 107 号皇冠大厦 11 楼
法定代表人:彭文德
联系人:刘芸
客户服务电话:400-8877-780
网址:www.cfc108.com
2)中信期货有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305、14 层
办公地址:广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305、14 层
法定代表人:张皓
联系人:刘宏莹
客户服务电话:400-990-8826
网址:www.citicsf.com
(4)第三方销售机构
1)北京百度百盈基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区上地十街 10 号百度大厦 2 层
办公地址:北京市海淀区上地十街 10 号
法定代表人:梁志祥
联系人:王笑宇
客户服务电话:95055
网址:https://www.baiyingfund.com/
2)北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
办公地址:北京市朝阳区望京 SOHO T3 A 座 19 层
法定代表人:钟斐斐
联系人:威晓强
客户服务电话:400-159-9288
网址:danjuanapp.com
3)北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号 5 层 5122 室
办公地址:北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号 5 层 5122 室
法定代表人:黄永伟
联系人:侯仁凤
客户服务电话:400-8980-618
网址:www.chtfund.com
4)北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号盈科中心东门 2 层 222 单元
办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号盈科中心东门 2 层
法定代表人:胡伟
联系人:陈铭洲
客户服务电话:400-618-0707
网址:www.hongdianfund.com
5)北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108
办公地址:北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108
法定代表人:王伟刚
联系人:王晓晓
客户服务电话:400-619-9059
网址:www.hcjijin.com
6)北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06
办公地址:北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东总部 A 座 17 层
法定代表人:江卉
联系人:韩锦星
客户服务电话:95118
网址:fund.jd.com
7)北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层
办公地址:北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层
法定代表人:闫振杰
联系人:马林
客户服务电话:4008188000
网址:www.myfund.com
8)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层
法定代表人:王莉
联系人:于扬
客户服务电话:400-920-0022
网址:licaike.hexun.com
9)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室
办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F
法定代表人:陈柏青
联系人:韩爱彬
客户服务电话:4000-766-123
网址:www.fund123.cn
10)南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
法定代表人:刘汉青
联系人:王锋
客户服务电话:95177
网址:www.snjijin.com
11)诺亚正行基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋
法定代表人:汪静波
联系人:朱了了
客户服务电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com
12)浦领基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室
办公地址:北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08
法定代表人:李招弟
联系人:李艳
客户服务电话:4008769988
网址:www.zscffund.com
13)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
办公地址:上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层
法定代表人:张跃伟
联系人:张佳琳
客户服务电话:400-820-2899
网址:www.erichfund.com
14)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号
办公地址:上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903-906 室
法定代表人:杨文斌
联系人:王诗玙
客户服务电话:400-700-9665
网址:www.howbuy.com
15)上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室
办公地址:北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层
法定代表人:李一梅
联系人:仲秋玥
客户服务电话:400-817-5666
网址:www.amcfortune.com
16)上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼
办公地址:上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋汇付天下总部大楼 2 楼
法定代表人:金佶
联系人:钱诗雯
客户服务电话:440-8202-819
网址:www.chinapnr.com
17)上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室
法定代表人:王翔
联系人:吴鸿飞
客户服务电话:400-820-5369
网址:www.jiyufund.com.cn
18)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室
办公地址:上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号陆家嘴软件园 10 号楼 12 楼
法定代表人:李兴春
联系人:陈孜明
客户服务电话:95733
网址:www.leadfund.com.cn
19)上海陆金所基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼
法定代表人:郭坚
联系人:陈铭洲
客户服务电话:400-821-9031
网址:www.lu.com
20)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层
办公地址:上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼
法定代表人:其实
联系人:高莉莉
客户服务电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn
21)上海挖财基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02/03 室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02/03 室
法定代表人:胡燕亮
联系人:李娟
客户服务电话:021-50810673
网址:www.wacaijijin.com
22)上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座
办公地址:上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼
法定代表人:王廷富
联系人:徐亚丹
客户服务电话:400-799-1888
网址:www.520fund.com.cn
23)上海中正达广基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室
办公地址:上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室
法定代表人:黄欣
联系人:戴珉微
客户服务电话:400-6767-523
网址:www.zzwealth.cn
24)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704
办公地址:北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层
法定代表人:马勇
联系人:文雯
客户服务电话:400-166-1188
网址:8.jrj.com.cn
25)深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼
办公地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801
法定代表人:薛峰
联系人:邓爱萍
客户服务电话:4006-788-887
网址:www.zlfund.cn、www.jjmmw.com
26)腾安基金销售(深圳)有限公司
注册地址:深圳市南山区高新科技园科技中一路腾讯大厦 11 层
办公地址:深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
法定代表人:刘明军
联系人:郑骏锋
客户服务电话:95017
网址:www.tenganxinxi.com
27)天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701
办公地址:北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505 室
法定代表人:林义相
联系人:谭磊
客户服务电话:010-66045678
网址:www.jjm.com.cn/
28)玄元保险代理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室
法定代表人:马永谐
联系人:卢亚博
客户服务电话:400-0808-208
网址:www.licaimofang.com
29)宜信普泽(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809
办公地址:北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C1809
法定代表人:戎兵
联系人:魏晨
客户服务电话:400-6099-200
网址:www.yixinfund.com
30)浙江金观诚基金销售有限公司
注册地址:杭州市拱墅区登云路 45 号(锦昌大厦)1 幢 10 楼 1001 室
办公地址:杭州市拱墅区登云路 55 号锦昌大厦 1 号楼 1 楼金观
法定代表人:徐黎云
联系人:来舒岚
客户服务电话:400-688-1888
网址:www.jincheng-fund.com
31)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903
办公地址:杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼
法定代表人:凌顺平
联系人:吴强
客户服务电话:4008773772
网址:www.5ifund.com
32)中期时代基金销售(北京)有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号
办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路 16 号 1 幢 11 层
法定代表人:路瑶
联系人:侯英建
客户服务电话:400-8888-160
网址:www.cifcofund.com
33)珠海盈米基金销售有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203
法定代表人:肖雯
联系人:黄敏嫦
客户服务电话:020-89629066
网址:www.yingmi.cn

基金管理人可根据有关法律法规要求,根据实情,选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述销售机构,并在基金管理人网站公示。

(二)注册登记机构
名称:鹏华基金管理有限公司
住所:深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层
法定代表人:何如
办公室地址:深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层
联系电话:(0755)82021877
传真:(0755)82021165
负责人:范伟强
(三)律师事务所
名称:北京市竞天公诚律师事务所
住所:北京市朝阳区建国路 77 号华贸中心 3 号写字楼 34 层
法定代表人:赵洋
办公室地址:北京市朝阳区建国路 77 号华贸中心 3 号写字楼 34 层
联系电话:(010)58091000;(0755)23982200
传真:(010)58091100;(0755)23982211
联系人:黄亮
经办律师:孔雨泉、黄亮
(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
法定代表人:李丹
办公室地址:上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:魏佳亮
经办会计师:许康玮、陈熹

四、基金的名称
本基金的名称:鹏华上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

五、基金的运作方式和类型
本基金为交易型开放式股票型证券投资基金联接基金,存续期间为不定期。

六、基金的投资目标
紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资范围
本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要投资于上证民营企业 50ETF(投资比例不低于基金资产净值的 90%)及上证民营企业 50 指数的成份股、备选成份股,现金或者到期日在一年以内的政府债券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。此外,为更好的实现投资目标,本基金将少量投资于非上证民营企业 50 指数成份股、新股(首次发行或增发等)以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

若法律法规或监管机构允许,本基金在履行适当程序后,可以调整上述投资比例,或将法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他金融工具纳入本基金的投资范围。

八、基金的投资策略
本基金为被动式指数基金,以上证民营企业 50ETF 作为其主要投资标的,方便特定客户群通过本基金投资上证民营企业 50ETF。本基金不参与上证民营企业 50ETF 的管理。

本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%,年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

1、资产配置策略
为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值 90%的资产投资于上证民营企业 50ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、非上证民营企业 50 成份股、新股(首次发行或增发等)、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。

2、目标 ETF 投资策略
(1) 投资组合的构建
基金合同生效后,本基金将主要按照标的指数成份股的基准权重构建股票组合,并在 3 个月内将股票组合换购成目标 ETF,使本基金投资于目标 ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%。

(2)投资组合的投资方式
本基金投资上证民营企业 50ETF 的两种方式如下:
1)申购和赎回:上证民营企业 50ETF 开放申购赎回后,通过其申购赎回代理券商以股票组合进行申购赎回。
2)二级市场方式:上证民营企业 50ETF 上市交易后,通过券商在二级市场进行上证民营企业 50ETF 基金份额的交易。
在遵守上海证券交易所相关规定的前提下,本基金将综合考虑上述两种方式的价格因素,以及基金规模、市场交易量等其他相关因素,选择合适的方式投资目标 ETF。

(3)投资组合的调整
本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资上证民营企业 50ETF 的时间和方式。
1)当收到净申购时,本基金将根据净申购规模及仓位情况,决定股票组合的构建、上证民营企业 50ETF 的申购或买入等;
2)当收到净赎回时,本基金将根据净赎回规模及仓位情况,决定上证民营企业 50ETF 的赎回或卖出等;

3、成份股、备选成份股投资策略
本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购上证民营企业 50ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸,主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

4、债券投资策略
本基金可以根据流动性管理需要,选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。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。

九、基金的业绩比较基准
上证民营企业 50 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。
本基金标的指数变更的,业绩比较基准随之变更并公告。

十、基金的风险收益特征
本基金属 ETF 联接基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数型基金,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

十一、基金的投资组合报告
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2019 年 7 月 15 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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告期自 2019 年 4 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。
1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	66,778,031.79	93.74
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	4,430,211.92	6.22
8	其他资产	30,497.06	0.04
9	合计	71,238,740.77	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合
(1)报告期末按行业分类的境内股票投资组合
注:无。
(2)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
注:无。
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
注:无。
4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:无。
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。
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。
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。
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。
9、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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	民企 ETF	股票型	ETF	鹏华基金管理有限公司	66,778,031.79	94.16

注:上述基金明细为本基金本报告期末持有的全部基金。
10、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
(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
(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
11、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
(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。
(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。
(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。
12、投资组合报告附注
(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。
(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。
(3)其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	961.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	801.79
5	应收申购款	28,734.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,497.06

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末未持有股票。
(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。

十二、基金的业绩
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财产,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,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金合同生效以来的投资业绩及其与同期基准的比较如下表所示:

	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
2010 年 08 月 05 日(基金合同生效日)至 2010 年 12 月 31 日	8.90%	1.39%	15.17%	1.61%	-6.27%	-0.22%
2011 年 01 月 01 日至 2011 年 12 月 31 日	-26.45%	1.31%	-26.32%	1.32%	-0.13%	-0.01%
2012 年 01 月 01 日至 2012 年 12 月 31 日	5.49%	1.33%	4.60%	1.32%	0.89%	0.01%
2013 年 01 月 01 日至 2013 年 12 月 31 日	14.08%	1.39%	13.56%	1.39%	0.52%	0.00%
2014 年 01 月 01 日至 2014 年 12 月 31 日	29.05%	1.06%	28.57%	1.07%	0.48%	-0.01%
2015 年 01 月 01 日至 2015 年 12 月 31 日	23.07%	2.22%	21.92%	2.24%	1.15%	-0.02%
2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日	-13.32%	1.38%	-13.07%	1.39%	-0.25%	-0.01%
2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	16.96%	0.65%	18.51%	0.66%	-1.55%	-0.01%
2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日	-28.03%	1.34%	-28.25%	1.40%	0.22%	-0.06%
2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日	25.16%	1.58%	26.70%	1.64%	-1.54%	-0.06%
自基金合同生效日至 2019 年 06 月 30 日	39.80%	1.41%	47.97%	1.43%	-8.17%	-0.02%

十三、基金的费用与税收
(一)基金费用的种类
1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。
(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1、基金管理人的管理费
本基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数,则取 0)的 0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×0.5%÷当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值-前一日所持有 ETF 基金份额部分的基金资产,若为负数,则 E 取 0
基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。
2、基金托管人的托管费
本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数,则取 0)的 0.1%年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.1%÷当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值-前一日所持有 ETF 基金份额部分的基金资产,若为负数,则 E 取 0
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。
上述"一、基金费用的种类"中第 3-8 项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。
(三)与基金销售有关的费用
1、申购费
本基金对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。
养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金,包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。
通过基金管理人的直销柜台申购本基金基金份额的养老金客户特定申购费率如下表:

申购金额 M(元)	特定申购费率
M<100 万	0.6%
100 万≤M <500 万	0.6%
M≥ 500 万	每笔 1000 元

其他投资者申购本基金基金份额的申购费率如下表:

申购金额 M(元)	申购费率
M<100 万	1.2%
100 万≤M <500 万	0.6%
M≥ 500 万	每笔 1000 元

投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。
本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取。本基金的申购费用不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。
2、转换费率:具体基金转换费率、适用基金及转换业务规则等相关规定详见基金管理人的相关公告。
3、赎回费:本基金的赎回费率按持有期限逐渐递减,具体费率如下:

持有期限(Y)	赎回费率
Y<7 日	1.5%
7 日≤Y<1 年	0.5%
1 年≤Y<2 年	0.25%
Y≥2 年	0

本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取。本基金的赎回费用由赎回申请人承担。本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产;对于持续持有期不少于 7 日的投资者,收取的赎回费总额的 25%归入基金财产,75%用于支付市场推广、注册登记费和其他手续费。
4、基金管理人和基金托管人协商后,可以根据《基金合同》的相关约定调整申购费率、降低赎回费率或调整收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 日在指定媒介公告。
5、对特定交易方式(如网上交易、电话交易等),在不违背法律法规规定的情况下,基金管理人可以采用低于柜台交易方式的基金申购费率和基金赎回费率。
6、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,例如针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。
7、当发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。
(四)不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:
1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
(五)费用调整
基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。
调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。
基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在指定媒介上公告。
(六)基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明
本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的规定,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金管理人原公告的本基金招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:
1、在"重要提示"部分明确了本次招募说明书更新的内容。
2、对涉及信息披露相关的内容进行了更新。

鹏华基金管理有限公司
2020 年 4 月

(上接C107版)

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,000,786.86	15.50
	其中:政策性金融债	10,000,786.86	15.50
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单