鹏华量化先锋混合型证券投资基金（原鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金）2018年半年度报告摘要

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：2018年08月27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2018年8月24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。

本基金系原鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金转型而来。鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金份额持有人大会于2018年1月8日表决通过了《关于鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》，鹏华基金管理有限公司决定对鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金进行基金份额折算和变更登记，转型为鹏华量化先锋混合型证券投资基金，基金份额折算基准日为2018年2月22日。根据《关于鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》、《鹏华基金管理有限公司关于鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议》分别修订为《鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同》、《鹏华量化先锋混合型证券投资基金托管协议》，并据此编制《鹏华量化先锋混合型证券投资基金招募说明书》。鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金根据中国证监会《关于准予鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2017]1052号）准予变更注册。《鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同》、《鹏华量化先锋混合型证券投资基金托管协议》将自鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金份额折算基准日的次一工作日起生效。

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，原鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金报告期自2018年1月1日至2018年2月22日止，鹏华量化先锋混合型证券投资基金报告期自2018年2月23日（基金合同生效日）至2018年6月30日止。

本报告中财务资料未经审计。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况(转型后)

基金简称	鹏华量化先锋混合
场内简称	-
基金主代码	006632
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月23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	31,263,101.07份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

2.2 基金基本情况(转型前)

基金简称	鹏华沪深300ETF
场内简称	A300ETF
基金主代码	159927
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年7月19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	32,712,954.48份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013年8月16日

2.3 基金产品说明(转型后)

投资目标	本基金通过运用量化选股策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，结合适当的资产配置策略，并做量产格的投资纪律和风险控制，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。1.资产配置策略 本基金通过对宏观环境和政策导向的分析等构建数量化模型，以对大类资产风险收益特性、投资者行为、市场情绪、市场风险偏好等进行系统分析和评估，本基金根据基本面分析框架，现代投资组合理论以及风险管理模型对大类资产进行综合评估，确定大类资产配置权重，同时合理使用金融工具实现对组合风险暴露的动态调整。2.股票投资策略 本基金对股票的投资采用“自上而下”的行业配置策略以及“自下而上”的量化选股策略，在足值化概念的基下，根据市场变化趋势，对模型进行动态调整。（1）行业配置策略 本基金的行业配置策略结合考虑行业的基本面、现代投资组合理论以及风险预算模型，结合定性和定量分析作出行业配置决策。在基金整体风险水平可控的前提下，实现各行业的合理配置和优化。（2）量化选股策略 本基金将以多因子选股策略构建股票投资组合。多因子选股策略的信息主要来自于基本面、预期数据、市场交易数据等，每一类信息代表一种选股逻辑，在不同的市场环境下，选股逻辑会有不同的侧重点。基于不同的选股逻辑，构建个股推荐度的多因子选股策略，包括价值、基本面、市场、成长、预期等，并对因子的有效性进行筛选分析和动态监控，筛选出有效因子组合，构建股票推荐组合。本基金在股票投资组合构建完成后，根据个股价格波动、风险收益变化的实际情况，定期或不定期调整个股权重，以确保整个股票组合的风险处于可控范围内。3.债券投资策略 本基债券投资将深入剖析债券、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、中小企业私募债投资策略等长期投资策略，灵活地调整组合的券种搭配，精选安全边际较高的个券。（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，本基金将根据调整组合长、中、短期债券的结配，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追踪调整的骑乘策略，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，以达成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、选择权因素，相规特点等因素，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 本基金通过主动收集信用风险类获取信用溢价，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，对其未来信用利差走势的判断，选择信用利差收益高、未来信用利差可能下调的债券进行投资。（7）中小企业私募债投资策略 本基金将深入研究发行人资信及公司治理情况，与中小企业私募债承销券商密切合作，合理内部合格地进行中小企业私募债投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级变化情况，力求规避可能存在的债券违约风险。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的绝对估值模型，价差策略、双向权益策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。5.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，在分析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。6.资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。

业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

注:无。

2.4 基金产品说明(转型前)

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。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当股票成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红、停牌方时，或因基金申购赎回导致组合规模变动导致组合偏离目标风险收益特征等原因，或因其他特殊情况导致被动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低偏离度和跟踪误差。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，如因指数编制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。本基金可投资权证，根据权益类证券的估值水平，追求稳定的当期收益。5.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，在分析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。6.资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。
业绩比较基准	标的指数，即沪深300指数。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。

注:无。

2.5 基金管理人和基托管人

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	0755-82225720	010-67596096
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788899	010-67596096
传真		0755-82221126	010-66275853

2.6 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（2018年1月1日-2018年6月30日）		
	转型前 报告期（2018年1月1日-2018年2月22日（基金合同失效日））	转型后 报告期（2018年2月23日（基金合同生效日）至2018年6月30日）	
本期已实现收益	-273,690.00	-2,270,015.15	
本期利润	61,463.54	-6,908,089.56	
加权平均基金份额本期利润	0.0075	-0.2053	
本期基金份额净值增长率	0.19%	-21.92%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018年2月22日（基金合同结束日））	报告期末（2018年6月30日）	
期末可供分配基金份额利润	0.4341	0.2149	
期末基金资产净值	32,712,954.49	24,411,432.00	
期末基金份额净值	1.0000	0.7808	

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

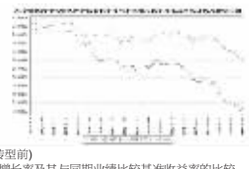
（3）表中的“期末”均指报告期最后一日，转型前为2月22日，转型后为6月30日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现(转型后)

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	-10.90	1.41	-6.03	1.02	-4.87	0.39
过去三个月	-18.99	1.19	-7.58	0.91	-11.41	0.28
过去六个月	-21.92	1.09	-10.15	0.87	-11.77	0.22
过去一年	-21.92	1.09	-10.15	0.87	-11.77	0.22
自基金成立起至今	-21.92	1.09	-10.15	0.87	-11.77	0.22

3.2.2 自基金转型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



3.3 基金净值表现(转型前)

3.3.1 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(%)
过去六个月	0.19	1.30	0.54	1.31	-0.36	-0.01
过去一年	9.76	0.85	10.53	0.86	-0.77	-0.01
过去三年	-11.58	1.52	-9.40	1.53	-2.18	-0.01
自基金成立起至今	76.71	1.52	80.50	1.54	-3.79	-0.02

3.3.2 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

3.4 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2018年6月，公司管理资产总规模达到5,232.30亿元，管理152只公募基金、10只全国社保投资组合、3只基本养老保险投资组合。经过近20年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介(转型后)

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		
崔俊杰	-	2013年7月19日	-	7	崔俊杰先生，国籍中国，金融工程专业管理学硕士，7年证券从业经验。2008年7月加盟鹏华基金管理有限公司，历任产品规划部产品设计师、量化投资部量化研究员、先锋从事产品设计、量化研究工作。2012年3月起担任鹏华深证民营ETF基金及其联接基金基金经理，2013年3月起兼任鹏华上证民企50ETF基金及其联接基金基金经理，2013年7月起兼任鹏华沪深300ETF基金基金经理，2014年12月起兼任鹏华创新分级基金基金经理，2014年12月起兼任鹏华传媒分级基金基金经理，2015年4月起兼任鹏华银行分级基金基金经理，2015年8月起兼任鹏华医药分级基金基金经理。崔俊杰先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

注:1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介(转型前)

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		
崔俊杰	本基金基金经理	2013-07-19	2018-02-23	10	崔俊杰先生，国籍中国，管理学硕士，10年证券从业经验。2008年7月加盟鹏华基金管理有限公司。历任产品规划部产品设计师、量化投资部量化研究员、先锋从事产品设计、量化研究工作。2013年03月担任鹏华深证民营ETF基金基金经理，2013年03月担任鹏华深证民营联接基金基金经理，2013年03月担任鹏华上证民企50ETF基金基金经理，2013年03月担任鹏华上证民企50联接基金基金经理，2013年07月担任鹏华沪深300ETF（2018年2月已转型为鹏华量化先锋混合）基金基金经理，2014年12月担任鹏华创新分级基金基金经理，2014年12月担任鹏华传媒分级基金基金经理，2015年06月至2016年07月担任鹏华医药分级基金基金经理，2016年07月担任鹏华中证医药卫生(LOF)基金基金经理，2016年11月担任鹏华香港银行指数（LOF）基金基金经理，2018年02月至2018年03月担任鹏华量化先锋混合基金基金经理。现同时担任量化先锋基金基金经理。崔俊杰先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动。

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 管理人对投资组合管理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利益的行为。

4.3 管理人对投资组合风险管理的专项说明

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 管理人对投资组合内部公平交易控制和监察稽核工作的执行情况说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年组合运作期内，整个A股市场波动剧烈，市场先扬后抑，风格分化较大，波动率和成交量相对去年有所提升。本基金来承指数基金的投资策略，在应对申购赎回的基础上，力争跟踪指数收益，并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金转型前份额净值增长率为0.19%，业绩比较基准净值增长率0.54%；基金转型后份额净值增长率为-21.92%，业绩比较基准净值增长率-10.15%

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2018年下半年，中国的宏观经济大概率稳中趋缓。随着国内消费日益成为经济增长的支撑力量，我们认为经济大幅下行的可能性不大，但是由于贸易战等外部不确定因素的存在，对经济增长可能会有一定的影响。2018年金融改革进展显著，对市场也造成了相当的冲击，这种格局在2018年下半年将开始发生一些变化。随着中国经济结构调整的推进，代表新经济的优质成长股将脱颖而出。

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6,719,574.86元，期末基金份额净值0.7808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

本基金自2018年5月25日至2018年6月29日期间出现连续二十个（或以上）工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§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，对本基的投资运作方面进行了监督，本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）(转型后)

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华量化先锋混合型证券投资基金
报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018年6月30日
资 产：	
银行存款	3,924,373.23
结算备付金	542,960.92
存出保证金	16,289.89
交易性金融资产	20,430,198.93
其中：股票投资	20,430,198.93
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	-
应收利息	1,032.89
应收股利	-
应收申购款	918.63
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	24,915,774.49
负债和所有者权益	**本期末 2018年6月30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	-
应付赎回款	14,409.49
应付管理人报酬	32,086.70
应付托管费	5,342.59
应付销售服务费	-
应付交易费用	95,857.97
应交税费	1.24
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	356,591.40
负债合计	504,342.49
所有者权益：	
实收基金	17,691,857.14
未分配利润	6,719,574.86
所有者权益合计	24,411,432.00
负债和所有者权益总计	24,915,774.49

注:（1）报告截止日2018年06月30日，基金份额净值0.7808元，基金份额总额31,263,101.07份。

（2）本基金合同生效日为2018年2月23日，无上年末可比较数据。

6.2 利润表

会计主体：鹏华量化先锋混合型证券投资基金
本报告期：2018年2月23日（基金合同生效日）至2018年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018年2月23日（基金合同生效日）至2018年6月30日
一、收入		-6,444,293.54
1.利息收入		27,039.90
其中：存款利息收入		17,334.41
债券利息收入		43.35
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		9,662.14
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,995,615.64
其中：股票投资收益		-2,115,415.41
基金投资收益		-
债券投资收益		8,836.29
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		110,964.48
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-4,638,074.41
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		162,356.61
减：二、费用		463,796.02
1. 管理人报酬	6.4.8.2.1	161,466.45
2. 托管费	6.4.8.2.2	26,909.26
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-
4. 交易费用		187,829.95
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.15
7. 其他费用		87,601.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,908,089.56
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,908,089.56

注:本基金合同生效日为2018年2月23日，无上年可比较期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华量化先锋混合型证券投资基金
本报告期：2018年2月23日（基金合同生效日）至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月23日（基金合同生效日）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）	18,512,437.26	14,200,517.23	32,712,954.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,908,089.56	-6,908,089.56
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）	-820,580.12	-572,852.81	-1,393,432.93
其中：1.基金申购款	12,880,653.20	8,159,468.60	21,040,118.80
2.基金赎回款	-13,701,233.32	-8,732,318.41	-22,433,551.73
四、本期向基金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）	17,691,857.14	6,719,574.86	24,411,432.00

注:本基金合同生效日为2018年2月23日，无上年可比较期间数据。

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	苏淑	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

鹏华量化先锋混合型证券投资基金是根据原鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“鹏华沪深300ETF基金”)基金份额持有人大会于2018年1月8日决议通过的《关于鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》，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[2017]1052号《关于准予鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复》核准，由鹏华沪深300ETF基金转型而来。原鹏华沪深300ETF基金存续期限至2018年2月22日止。自2018年2月23日起，原鹏华沪深300ETF基金更名为鹏华量化先锋混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，《鹏华沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》失效的同时《鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约开放式，存续期限不定。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。

原鹏华沪深300ETF基金失效前的基金资产净值为32,712,954.49元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《鹏华沪深300 交易型开放式指数证券投资基金份额折算和变更登记结果公告》的有关规定，本基金的基金管理人于2018 年2月22日日终对投资者持有的鹏华沪深300ETF基金基金份额变更登记为本基金基金份额，基金份额总额为32,712,954.48份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华量化先锋混合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(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、超短期融资券、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(含回业存单等)、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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为60%－95%；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%，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%。

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）》、《深证民营交易平台关于非标准股票投资业务会计核算业务指引》、《深证民营交易平台关于证券投资基金核算业务指引》、《深证民营交易平台关于证券投资基金信息披露业务指引》、《深证民营交易平台关于证券投资基金业务会计