（上接B061版）

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	136,236,40	1.81
B	采矿业	899,069.00	11.97
C	制造业	4,626,102.68	60.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	189,396.00	2.52
E	建筑业	89,584.00	1.19
F	批发和零售业	275,069.10	3.66
G	交通运输、仓储和邮政业	10,952.00	0.15
H	住宿和餐饮业	20,008.00	0.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	80,190.00	1.07
J	金融业	631,529.03	8.41
K	房地产业	106,496.00	1.42
L	租赁和商务服务业	151,970.00	2.02
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	18,360.00	0.24
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	19,662.00	0.26
S	综合	–	–
	合计	7,154,504.21	95.26

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注:无。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600516	方大炭素	12,200	371,002.00	4.94
2	601012	隆基股份	9,900	355,806.00	4.74
3	000166	申万宏源	73,160	348,973.20	4.65
4	002202	金风科技	19,793	331,710.60	4.42
5	601225	陕西煤业	38,200	307,128.00	4.09
6	600089	特变电工	37,188	301,594.68	4.02
7	600893	航发动力	10,400	257,920.00	3.43
8	000768	中航飞机	14,800	247,160.00	3.29
9	000792	盐湖股份	15,500	200,570.00	2.67
10	002673	西部证券	21,499	197,146.83	2.62

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的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注:无。

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	600893	航发动力	369,583.00	4.32
2	601225	陕西煤业	232,905.00	2.80
3	000166	申万宏源	225,369.00	2.71
4	600089	特变电工	158,270.00	1.90
5	002202	金风科技	138,722.00	1.67
6	601012	隆基股份	136,530.00	1.64
7	002092	中泰化学	131,174.00	1.58
8	600516	方大炭素	121,293.00	1.46
9	000768	中航飞机	93,582.00	1.12
10	002673	西部证券	83,449.00	1.00
11	000792	盐湖股份	81,699.00	0.98
12	600456	宝钛股份	81,528.00	0.98
13	601168	西部矿业	58,257.00	0.70
14	002185	华天科技	54,091.00	0.65
15	600075	新疆天业	41,174.00	0.49
16	600771	广誉远	39,674.00	0.48
17	600339	中油工程	38,387.00	0.46
18	601179	中国西电	37,229.00	0.45
19	600307	酒钢宏兴	35,138.00	0.42
20	600256	广汇能源	33,105.00	0.40

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

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	600893	航发动力	342,689.48	4.12
2	601012	隆基股份	294,883.00	3.54
3	2202	金风科技	215,380.00	2.59
4	166	申万宏源	183,364.00	2.2
5	601225	陕西煤业	153,318.00	1.84
6	600089	特变电工	147,988.00	1.78
7	600516	方大炭素	121,779.00	1.46
8	697	海石有色	108,792.00	1.31
9	768	中航飞机	99,920.00	1.2
10	2673	西部证券	84,439.00	1.01
11	792	盐湖股份	84,402.00	1.01
12	2092	中泰化学	81,713.00	0.98
13	600165	新日恒力	71,445.00	0.86
14	601168	西部矿业	59,592.00	0.72
15	2185	华天科技	56,573.00	0.68
16	600707	彩虹股份	52,575.00	0.63
17	600256	广汇能源	52,516.00	0.63
18	601179	中国西电	38,950.00	0.47
19	617	中油资本	36,020.00	0.43
20	600307	酒钢宏兴	35,445.00	0.43

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	2,893,173.00
卖出股票收入（成交）总额	3,078,893.48

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

注:无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库

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	16,289.89
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	1,032.89
5	应收申购款	918.63
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	18,241.41

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300072	三聚环保	566,868.00	2.32	重大事项

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。

§ 7 投资组合报告(转型前)

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	占基金资产的比例（%）
1	权益投资	32,674,750.56	98.37
	其中:股票	32,674,750.56	98.37
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	539,355.53	1.62
8	其他各项资产	834.00	0.00
9	合计	33,214,940.09	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而7.2.1的合计项不含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	72,197.20	0.22
B	采矿业	1,070,708.82	3.27
C	制造业	12,759,515.96	39.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	847,481.09	2.59
E	建筑业	1,215,073.83	3.71
F	批发和零售业	639,466.15	1.96
G	交通运输、仓储和邮政业	1,038,076.25	3.17
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,154,523.69	3.53
J	金融业	11,207,438.04	34.26
K	房地产业	1,765,386.27	5.40
L	租赁和商务服务业	411,887.80	1.26
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	119,881.30	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	110,673.00	0.34
R	文化、体育和娱乐业	237,962.16	0.73
S	综合	24,549.00	0.08
	合计	32,674,750.56	99.88

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注:无。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:无。

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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601318	中国平安	30,282	2,112,775.14	6.46
2	600519	贵州茅台	1,321	980,776.45	3.00
3	600036	招商银行	28,799	907,168.50	2.77
4	000651	格力电器	13,468	740,055.42	2.26
5	000333	美的集团	11,706	680,528.70	2.08
6	601166	兴业银行	34,820	631,634.80	1.93
7	600887	伊利股份	17,002	582,318.50	1.78
8	600016	民生银行	66,160	565,668.00	1.73
9	601328	交通银行	76,940	510,881.60	1.56
10	601288	农业银行	107,040	461,342.40	1.41

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。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注:无。

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

注:无。

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

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	000333	美的集团	58,700.00	0.18
2	300104	乐视网	32,653.00	0.10
3	600074	*ST保千	8,456.00	0.03

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	–
卖出股票收入（成交）总额	99,809.00

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:无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

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

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	1,989.14
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	1,827.21
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	3,816.35

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:无。

7.12.5.2 期末积极投资前五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(转型后)

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（%）
672	10,902.27	4,108,465.21	56.08	3,217,857.88	43.92

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	8.11	0.00

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

注:截止本报告期末,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未持有本基金份额。

§ 8 基金份额持有人信息(转型前)

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	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（%）
新丝路	943	4,323.36	1,949.24	0.05	4,074,978.83	99.95
新丝路A	37	66,438.53	33,996.50	1.38	2,424,229.07	98.62
新丝路B	199	4,894.36	38,567.62	3.96	935,410.29	96.04
合计	1,179	6,369.07	74,513.36	0.99	7,434,618.19	99.01

8.2 期末上市基金前十名持有人

新丝路

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	朱晓琴	82,013.67	12.14
2	罗鹏	41,587.46	6.16
3	谈光广	38,136.86	5.65
4	黄燕	27,592.62	4.09
5	廖道雄	27,047.94	4.01
6	李怡名	24,785.29	3.67
7	刘子惠	24,291.22	3.60
8	王力	20,440.00	3.03
9	殷茵	19,277.61	2.85
10	张世喜	19,150.67	2.84

新丝路A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	李怡名	1,711,547.09	69.62
2	丁舞雯	298,167.78	12.13
3	黄晓	110,302.46	4.49
4	黄英	104,415.53	4.25
5	邵巧莉	72,968.99	2.97
6	余志胜	53,188.92	2.16
7	深圳市钧盛资产管理有限公司－钧盛绝对收益	33,480.10	1.36
8	张双全	20,138.49	0.82
9	罗四信	16,214.88	0.66
10	柏建华	10,327.96	0.42

新丝路B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	李雯蓉	167,774.21	17.23
2	余朝东	112,715.64	11.57
3	杨柏松	47,283.70	4.85
4	黄建盛	46,831.01	4.71
5	黄建辉	44,644.31	4.58
6	周小军	40,920.54	4.20
7	郭丽君	38,476.37	3.95
8	卢国辉	35,109.92	3.60
9	湖北开阳科技咨询开发中心	23,009.05	2.37
10	薛铁进	22,138.00	2.27

注:持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	新丝路	8.11	0.0002
	新丝路A	–	–
	新丝路B	–	–
	合计	8.11	0.0001

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。

8.4 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

注:截止本报告期末,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未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动（转型后）

单位:份

基金合同生效日（2018年6月26日）基金份额总额	7,509,131.56
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	74,660.46
减:基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	257,468.92
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	–
本报告期期末基金份额总额	7,326,323.09

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。

§ 9 开放式基金份额变动（转型前）

单位:份

项目	新丝路	新丝路A	新丝路B
基金合同生效日（2015年8月13日）基金份额总额	256,401,269.95	41,075,869.00	41,075,869.00
本报告期期初基金份额总额	5,968,068.51	2,292,819.00	2,292,819.00
本报告期基金总申购份额	17,890,774.75	–	–
减:本报告期基金总赎回份额	18,031,779.30	–	–
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-1,750,135.89	165,406.57	-1,318,841.09
本报告期期末基金份额总额	4,076,928.07	2,458,225.57	973,977.91

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

自2018年3月16日至2018年4月1日,鹏华新丝路指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）的份额持有人大会以通讯方式召开。本基金基金份额持有人大会于2018年4月10日表决通过了《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金部分条款调整的议案》,本次基金份额持有人大会决议自通过起生效。

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

基金管理人的重大人事变动:基金管理人本报告期内无重大人事变动。 本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

鹏华新丝路分级由指数基金转型为沪深300指数增强基金。基金采用量化多因子模型选股进行指数增强。模型侧重于长期表现有效的因子类别,并重视短期市场情绪因子的适度把握,从而将模型的短期与长期有效性进行平衡与提高。

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(转型后)

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	
东方财富证券	1	8,057,360.06	61.64%	6,537.03	58.85%	–
天风证券	1	5,015,111.20	38.36%	4,570.27	41.15%	–
川财证券	2	–	–	–	–	–
东北证券	1	–	–	–	–	–
东方证券	1	–	–	–	–	–
方正证券	2	–	–	–	–	–
广发证券	1	–	–	–	–	–
国金证券	1	–	–	–	–	–
平安证券	1	–	–	–	–	–
山西证券	1	–	–	–	–	–
西南证券	1	–	–	–	–	–
招商证券	1	–	–	–	–	–
浙商证券	2	–	–	–	–	–
中泰证券	1	–	–	–	–	–
中信建投	1	–	–	–	–	–
国建证券	1	–	–	–	–	本报告期新增
安信证券	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

注:无。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

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	
安信证券	2	1,541,268.00	26.81%	1,404.67	26.88%	–
天风证券	1	1,354,323.00	22.68%	1,234.23	22.74%	–
招商证券	1	1,061,400.48	17.77%	967.31	17.82%	–
方正证券	1	1,047,177.00	17.53%	954.31	17.58%	–
中泰证券	2	819,131.00	13.72%	746.84	13.76%	–
东方财富证券	1	148,767.00	2.49%	120.71	2.22%	–
东北证券	1	–	–	–	–	–
广发证券	1	–	–	–	–	–
国金证券	1	–	–	–	–	–
平安证券	1	–	–	–	–	–
川财证券	1	–	–	–	–	–
西南证券	2	–	–	–	–	–
浙商证券	1	–	–	–	–	–
中信建投	1	–	–	–	–	–
东方证券	1	–	–	–	–	–
山西证券	1	–	–	–	–	本报告期新增

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

注:本基金本报告期内未通过券商交易单元进行债券交易、债券回购交易及权证交易。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息（转型后）

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。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息（转型前）

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

投资者类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
			期初份额	申购份额	赎回份额		持有份额	份额占比（%）
机构	1	20180312-20180318	–	5,405,405.00	5,405,405.00		–	0.00
	2	20180312-20180321	–	20,269,821.00	20,269,821.00		–	0.00
产品特有风险								
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。								

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、场内买入份额、指数分级基金合并份额和红利再投;

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、场内卖出份额和指数分级基金拆分份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息（转型前）

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

投资者类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
			期初份额	申购份额	赎回份额		持有份额	份额占比（%）
机构	1	20180223-20180514,20180523-20180630	8,163,224.19	–	–		8,163,224.19	26.11
个人	–	–	–	–	–		–	–
产品特有风险								
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。								

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、场内买入份额、指数分级基金合并份额和红利再投;

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、场内卖出份额和指数分级基金拆分份额。

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

2018年08月27日

（上接B062版）

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:无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库

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	29,448.12
2	应收证券清算款	11,700,000.00
3	应收股利	–
4	应收利息	3,699,748.69
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	15,429,196.81

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110032	三一转债	14,363,060.00	8.23
2	113014	林洋转债	10,015,145.40	5.73
3	128013	洪涛转债	30,919.60	0.02

7.11.5 期末前十名