

(上接B063版)

联系人:段承华
客户服务电话:96682
网址:www.westsecu.com

52) 西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北北区北桥南路8号
办公地址:重庆市江北北区桥北苑6号
法定代表人:廖庆轩
联系人:李洪
客户服务电话:4008906096/95355
网址:www.swsc.com.cn

51) 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:96351
网址:www.xscj.com

52) 湘时代证券股份有限公司
注册地址:北京市海淀区三环西路99号院1号楼15层1601
办公地址:北京市海淀区三环西路99号院1号楼15层1601
法定代表人:叶顺德
联系人:田芳芳
客户服务电话:95399
网址:www.xstzq.cn

53) 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:953121
网址:www.cindasc.com

54) 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:苏琳雪
客户服务电话:95662
网址:www.xyzq.com.cn

55) 银泰证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼
办公地址:深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼
法定代表人:黄水
联系人:陈文宇
客户服务电话:4008-505-0765-28810131
网址:www.yztz.net

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:官少林
联系人:林思远
客户服务电话:95665
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:杭州市西湖区五星路201号浙商证券大楼6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:毕明健(代)
联系人:杨宇宇
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:北京市朝阳区东四环中路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:胡刚
客户服务电话:40088-95618
网址:www.e618.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:邵宾斌
客户服务电话:4008-889-889/9557551
网址:www.chinastock.com.cn

61) 中泰证券股份有限公司
注册地址:济南市市中区经七路90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.zt.com.cn

62) 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:北京市朝阳区门内大街189号
法定代表人:王常青
联系人:刘杨
客户服务电话:95687/4008-888-108
网址:www.csc108.com

63) 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:北京市朝阳区福安街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.cscitic.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号上站大楼附楼11-B, 名义11-A, B-14, B-4, 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:彭艺波
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1301-1303、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1301-1303、14层
法定代表人:张皓
联系人:刘雯莹
客户服务电话:400-990-8826
网址:www.citicfc.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:王美宇
客户服务电话:95055
网址:https://www.baiyingfund.com/

2) 北京恒泰基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环东大街1号院6号楼2单元21层222607
办公地址:北京市朝阳区望京SOHO T3 A座19层
法定代表人:钟樊斐
联系人:魏晨露
客户服务电话:400-159-9288
网址:dnjiaanapp.com

3) 北京天明泽丰基金销售有限公司
注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号5层1222室
办公地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号5层1222室
法定代表人:黄永涛
联系人:侯仁凤
客户服务电话:400-8980-618
网址:www.chtfund.com

4) 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:王博刚
联系人:王骁骁
客户服务电话:400-619-9069
网址:www.hcfj.com

5) 北京特瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区东大街东66号1号楼22层2203-06
办公地址:北京市大兴区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东总部A座17层
法定代表人:江卉
联系人:杨静雅
客户服务电话:95119
网址:fund10.com

6) 北京鼎峰耀华基金销售有限公司
注册地址:北京市延庆区延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街19号A座1505室
法定代表人:张冠宇
联系人:王国柱
客户服务电话:400-819-0988
网址:http://www.tdyhfund.com/Index

7) 北京新浪乐石基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(二期扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(二期扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法定代表人:李曙阳
联系人:李慧真
客户服务电话:010-62675369
网址:www.xinlei.com

8) 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:周振杰
联系人:马林
客户服务电话:4008188000
网址:www.myfund.com

9) 海银基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室

办公地址:上海市浦东新区银城中路8号4楼
法定代表人:刘慧
联系人:刘晖
客户服务电话:400-808-1016
网址:www.fundshiny.com

10) 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:于浩
客户服务电话:400-920-0022
网址:lhcitikehebox.com

11) 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:胡爱敏
客户服务电话:4000-766-123
网址:www.fund123.cn

12) 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:李晔
客户服务电话:956177
网址:www.sanjin.com

13) 诺亚正行基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区 甯江路399号9724室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号A栋
法定代表人:汪涛
联系人:李丹
客户服务电话:400-921-5399
网址:www.noah-fund.com

14) 浦银基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区望京园四区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:李昭勇
联系人:李艳
客户服务电话:4008769888
网址:www.zsfund.com

15) 上海长江证券投资管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢2202室
办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人:张宏伟
联系人:张佳佳
客户服务电话:400-820-2899
网址:www.sczfund.com

16) 上海大智慧基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼1102单元
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102.1103单元
法定代表人:申健
联系人:张妮
客户服务电话:021-20292031
网址:www.wg.com.cn

17) 上海好买基金销售有限公司
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号泰康大厦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.howbuy.com

19) 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:吴鸣飞
客户服务电话:400-820-6369
网址:www.jiyufund.com.cn

20) 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:陈智渊
客户服务电话:400-821-9031
网址:www.lujin.com

21) 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楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号302室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

22) 上海搜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:胡洪亮
联系人:李婧
客户服务电话:021-50810673
网址:www.wacaijin.com

23) 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:上海市浦东新区浦电路1500号万得大厦11楼
法定代表人:王廷雷
联系人:徐亚平
客户服务电话:400-799-1888
网址:www.52fund.com.cn

24) 深圳市长兰德证券投资有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道田田路70号华融大厦27层2704
办公地址:深圳市福田区宣武门大街28号富都大厦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.jr.com.cn

25) 深圳众禄基金销售有限公司
注册地址:深圳市罗湖区梨园街物资控股置地大厦8楼2
办公地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园街物资控股置地大厦8楼201
法定代表人:薛峰
联系人:邓爱华
客户服务电话:4006-788-887
网址:www.zlfund.com, www.jimw.com

26) 腾安基金销售有限公司(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(入驻深圳前海商
务秘书有限公司)
法定代表人:刘明军
联系人:郑璇
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:北京市西城区金融大街19号富都大厦B座701
办公地址:北京市西城区新街口大街2号C座506室
法定代表人:林文彬
联系人:李磊
客户服务电话:010-66406678
网址:www.tj.com.cn/

28) 多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:马永涛
联系人:卢宇博
客户服务电话:400-0808-208
网址:www.lidamifang.com

29) 宜信普信(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路809号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路809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) 浙江网际基金销售有限公司
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号网际大厦
法定代表人:凌顺平
联系人:吴强
客户服务电话:400873372
网址:www.5ifund.com

31) 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楼12楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
联系人:黄敏娜
客户服务电话:020-89629066
网址:www.yingmi.com

基金管理人可根据有关法律法规及规定,根据实际,选择其他符合要求的机构代
理销售本基金或变更上述代销机构,并及时公告。

(二) 注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
联系电话:010-59387872
传真:010-59388907
负责人:赵亦清
(三) 律师事务所
名称:北京市竟天公诚律师事务所
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:赵海
办公地址: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) 23862200
传真:(010) 58091100/(0755) 23862211
联系人:姜英
经办律师:孔雨晨、黄莹
(四) 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号展业银行大厦6楼
法定代表人:李丹
办公室地址:上海市湖路路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:许伟琪、陈燕

四、基金的名称
本基金名称:鹏华中证500指数证券投资基金(L0F)

五、基金运作方式及类型
本基金为股票型基金,存续期间为不定期。

六、基金的投资目标
本基金采用指数化投资方式,追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化,力争年化跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内,以实现对中国证500指数的有效跟踪。

七、基金的投资方向
本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要投资于中证500指数的成份股及其备选股成份(投资比例不低于基金资产净值的90%)、现金或者到期日在一年以内的政府债券等,此外,为更好的实现投资目标,本基金还可包括投资于非中证500成份股、新股(首次发行或增发)以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其它金融工具。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略
本基金采用被动式指数投资方法,原则上按照成份股在中证500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。
当期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致跟踪误差扩大,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调整和替换,力求降低跟踪误差。
为实现紧密跟踪业绩比较基准的投资目标,本基金将不低于基金资产净值90%的资产投资于中证500指数的成份股和备选股成份,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。
2. 股票投资策略
(1) 股票投资组合的构建
本基金在建仓期内,将按照中证500指数各成份股的基准权重对其逐步买入,在力求跟踪误差最小化的前提下,本基金可采取适当方式,以降低买入成本,当到期成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依拟复制策略买入成份股和当期标的指数的成份股时将调整或其他因素影响复制的因时,本基金可以根据市场情况,结合研究分析,对基金资产进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。
(2) 股票投资组合的调整
本基金所构建的股票投资组合将根据中证500指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,本基金还将根据法律法规中的成份股停牌、申购赎回变动情况、新股增发因素等变化,对其进行适时调整,以保证本基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性不佳的个股将可能采用合理方法寻求替代,对于受到各项替代比例限制,基金可能无法按成份股权重持有成份股,基金将会采用合理方法寻求替代。
1) 定期调整
根据标的指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。
2) 不定期调整
根据指数编制规则,当中证500指数成份股因增发、配股等股权变动而需进行成份股重新调整时,本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整;
根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数;
根据法律法规规定,成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的,本基金可以对投资组合管理进行适当调整和替换,力求降低跟踪误差。
3. 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走势,并利用债券定价技术,进行品种选择。
九、基金业绩比较基准
本基金业绩的比较基准为:中证500指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。
中证500指数扣除了沪深300指数样本及最近一年日均总市值排名前300名的股票,再将按照最近一年(新股为上市以来)的日均成交额由高到低排名,剔除排名后20%的股票,然后将剩余股票按照日均总市值由高到低进行排名,选取排名在前50名的股票作为该指数样本。该指数以调整股本为权重,采用派许加权综合价格指数公式进行计算,其中调整股本根据个股级数方法获得。该指数综合反映了沪深证券市场内中大盘公司的整体状况,本基金充分考虑本基金各资产投资比例要求从而构建上述业绩比较基准。
中证500指数估值编制及发布,或中证500指数估值机构发生变更(单纯更名除外),或由于指数编制方法变更导致变更中证500指数不宜继续作为本基金的标的指数,本基金管理人将在履行适当程序后,以中证500指数的指数和权重比较基准,并在变更前两个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。

十、基金的风险收益特征
本基金属于采用指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险品种,较高预期收益品种。

十一、基金的投资组合报告
基金管理人及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) | 占基金总资产比例(%) |
|----|----------|----------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 294,395,044.33 | 92.97 |
| 2 | 固定收益 | 294,395,044.33 | 92.97 |
| 3 | 银行存款 | - | - |
| 4 | 应收股利 | - | - |
| 5 | 应收利息 | - | - |
| 6 | 其他金融资产 | 411,280.00 | 0.13 |
| 7 | 资产减值准备 | - | - |
| 8 | 持有待售金融资产 | - | - |
| 9 | 递延所得税资产 | - | - |
| 10 | 其他 | 17,369,565.07 | 5.42 |
| 11 | 负债 | 2,963,224.63 | 0.93 |
| 12 | 净资产 | 314,877,384.67 | 98.00 |

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(指数投资部分)

| 代码 | 行业名称 | 公允价值(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|------------------|----------------|-------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 3,203,100.00 | 1.02 |
| B | 采矿业 | 59,469,262.78 | 18.92 |
| C | 制造业 | 186,170,779.78 | 59.23 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 9,179,883.77 | 2.92 |
| E | 建筑业 | 5,238,943.76 | 1.67 |
| F | 批发和零售业 | 38,408,943.34 | 12.22 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 9,866,172.77 | 3.12 |
| H | 住宿和餐饮业 | 3,143,260.00 | 0.99 |
| I | 金融业 | 35,427,435.00 | 11.27 |
| J | 房地产业 | 19,579,791.11 | 6.23 |
| K | 信息技术服务业 | 4,440,737.00 | 1.41 |
| M | 医药制造业 | 3,428,300.00 | 1.09 |
| N | 采掘业 | 3,428,300.00 | 1.09 |
| O | 服务业 | - | - |
| P | 国防 | 3,428,300.00 | 1.09 |
| Q | 其他 | 6,102,260.00 | 1.94 |
| 合计 | | 411,280.00 | 0.13 |

(2) 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

| 代码 | 行业名称 | 公允价值(元) | 占基金总资产比例(%) |
|----|------------------|----------------|-------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 294,395,044.33 | 92.97 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 176,170,779.78 | 55.39 |
| 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 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 金融业 | - | - |
| J | 房地产业 | - | - |
| K | 信息技术服务业 | - | - |
| L | 医药制造业 | - | - |
| M | 采掘业 | - | - |
| N | 其他 | - | - |
| 合计 | | 294,395,044.33 | 92.97 |

(3) 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
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股票投资明细
(1) 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

| 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 | 600036 | 招商银行 | 323,390 | 3,362,200.00 | 1.07 |
| 2 | 600050 | 中国联通 | 8,700 | 3,264,000.00 | 1.03 |
| 3 | 000002 | 万科A | 3,300 | 3,207,000.00 | 1.02 |
| 4 | 600337 | 东方证券 | 55,200 | 3,109,200.00 | 0.98 |
| 5 | 600349 | 圣邦股份 | 20,200 | 3,048,200.00 | 0.97 |
| 6 | 600000 | 浦发银行 | 200,700 | 2,423,100.00 | 0.77 |
| 7 | 000010 | 深赛格 | 95,120 | 2,414,280.00 | 0.77 |
| 8 | 000066 | 中国电建 | 126,700 | 2,411,240.00 | 0.77 |
| 9 | 600156 | 华信新材 | 1,201,000 | 2,393,000.00 | 0.76 |
| 10 | 600288 | 包装印刷 | 20,200 | 2,388,000.00 | 0.76 |

(2) 指数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

| 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 | 000001 | 平安银行 | 27,480 | 264,024.00 | 0.08 |
| 2 | 000002 | 万科A | 143 | 16,027.00 | 0.01 |
| 3 | 000003 | 招商银行 | 33,100 | 349,630.00 | 0.11 |
| 4 | 000004 | 比亚迪 | 7,032 | 37,264.00 | 0.01 |
| 5 | 000009 | 深大通 | 1,201 | 30,000.00 | 0.01 |

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) 本基金股指期货投资的投资政策
本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
10. 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
(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
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。
11. 投资组合报告附注
(1)
正邦科技 正邦科技 本组合投资的前十名证券之一江西正邦科技股份有限公司(以下简称“公司”)关于公司下属分子公司收到《行政处罚决定书》及《责令改正违法行为决定书》的公告本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
近日,江西正邦科技股份有限公司(“公司”)下属子公司肇东正邦养殖有限公司收到肇东市环境保护局出具的《行政处罚决定书》(肇环罚[2018]10506号)、《行政处罚决定书》(肇环罚[2018]10607号)及《责令改正违法行为决定书》(肇环责改字[2018]10607号);公司下属子公司肇东正邦养殖有限公司充分公开公司收到肇东市环境保护局出具的《行政处罚决定书》(肇环罚[2018]1180606号)、《行政处罚决定书》(肇环罚[2018]10608号)及《责令改正违法行为决定书》(肇环责改字[2018]10608号)。
公司的整改措施
公司得知上述情况后,第一时间派出专项工作组驻点肇东,查明原因并督促整改。
1.及时缴纳罚款、追加投资、立限整改。接到环保处罚决定书后,公司及时足额缴纳罚款,针对环保罚开出的罚单,公司派专人负责,逐项开展整改,确保在规定时间内完成整改,整改工作包括但不限于:检验污水处理设备,搭建堆粪场遮棚、维修氨化罐并拆废氨化罐氧化池进行处理,为保证将来环保设施的稳定运行,公司将新增氨化罐,增加氨化罐容量,进一步保障环保运行能力。
2.加强管理,强化环保工作的严肃性。公司以上述问题为典型,召开环保专题会议和培训,学习《环保法》,查看养殖相关法律法规及主要文件,对养殖场人员和环保专责人员进行养殖环保相关工作操作要点等。公司将环保问题纳入重点考核范围内,对违规行为从重处罚。
3.处理相关责任人。查明原因后,对相关责任人进行严肃处理。对黑龙江片区副总进行降职使用,对养殖场场长予以开除。
三、对公司的影响
本次受处罚金额累计为205万元,占公司2017年度营业收入的0.01%,占公司2017年度归属于上市公司股东的净利润的0.39%,占公司2017年度净资产的0.03%,不会对公司的生产、经营造成重大影响。
此外,公司及分子公司为了进一步提高环保管理水平,在生产过程中持续加强对环保的控制与监督,严格遵守相关法律法规,切实履行环境保护责任。
对上述股票的投资决策程序说明:本基金为指数基金,为了更好地跟踪标的指数,控制跟踪误差,对该证券的投资属于按照指数成分股权重进行配置,符合指数基金的管理规定,该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程,符合法规和合同约定的规定。
(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选择库。
(3) 其他资产情况

| 序号 | 名称 | 金额(人民币元) |
|----|--------|--------------|
| 1 | 国债逆回购 | 36,790.03 |
| 2 | 银行存款 | 2,097,770.06 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,174.00 |
| 5 | 其他金融资产 | 411,280.00 |
| 7 | 资产减值准备 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 合计 | | 2,548,034.09 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:无。
(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
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。
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。
(6) 投资报告中涉及到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之和项之和与合计项之间可能存在尾差。
十二、基金的费用
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。投资者如购买,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业绩表现及其与同期基准的比较如下表所示:

| 期间 | 业绩比较基准 | 净值增长率 | 业绩比较基准 | 净值增长率 | 业绩比较基准 | 净值增长率 |
|-------------------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 2019年01月01日至2019年03月31日 | 0.00% | 0.04% | 0.00% | 0.00% | -0.08% | -0.04% |
| 2019年04月01日至2019年06月30日 | -0.23% | 1.86% | -0.23% | 1.49% | -0.01% | 0.00% |
| 2019年07月01日至2019年09月30日 | -0.20% | 1.46% | 0.48% | 1.80% | -0.77% | -0.01% |
| 2019年10月01日至2019年12月31日 | 0.00% | 1.07% | 0.16% | 1.07% | 0.04% | 0.00% |
| 2019年01月01日至2019年12月31日 | 0.00% | 1.03% | 0.01% | 1.03% | 0.00% | 0.00% |
| 2019年01月01日至2019年03月31日 | 0.00% | 0.00% | 0.00% | 0.00% | 0.00% | 0.00% |
| 2019年04月01日至2019年06月30日 | -1.42% | 1.00% | -1.07% | 1.13% | 0.44% | 0.00% |
| 2019年07月01日至2019年09月30日 | 0.44% | 0.00% | -0.11% | 0.00% | 0.00% | 0.00% |
| 2019年10月01日至2019年12月31日 | -2.81% | 1.42% | -2.03% | 1.47% | 0.20% | 0.00% |
| 2019年01月01日至2019年12月31日 | 0.00% | 1.04% | 0.76% | 1.07% | 0.01% | |