

# B054 信息披露 | Disclosure

(上接B053版)

客户服务电话:400-821-9031  
 网址:www.ljuc.com  
 19)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196号30C10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.1224567.com  
 20)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)自由贸易试验区高南路799号5层01、02/03室  
 法定代表人:胡燕飞  
 联系人:李婧  
 客户服务电话:021-50810673  
 网址:www.wacaijin.com  
 21)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:徐亚平  
 客户服务电话:400-799-1888  
 网址:www.520fund.com.cn  
 22)深圳市新兰地证券投资咨询有限公司  
 注册地址:深圳市福田区福田街道福民田178号华融大厦27楼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:艾雯  
 客户服务电话:400-788-8877  
 网址:www.zlfund.com、www.jjmmw.com  
 24)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:010-66046678  
 网址:www.txsec.com  
 23)深圳众禄基金销售有限公司  
 注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道笋岗社区海田大厦8楼  
 办公地址:深圳市罗湖区笋岗街道笋岗社区海田大厦8楼801  
 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.jjmmw.com  
 24)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:010-66046678  
 网址:www.txsec.com  
 25)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89号院9号楼151809  
 办公地址:北京市朝阳区建国路89号SOHO现代城C1809  
 法定代表人:戎兵  
 联系人:魏巍  
 客户服务电话:400-6099-200  
 网址:www.yixinfund.com  
 26)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003  
 办公地址:杭州市余杭区五常街道同顺路18号同顺大厦  
 法定代表人:凌顺平  
 联系人:吴昊  
 客户服务电话:4008773772  
 网址:www.5ifund.com  
 27)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:袁敏婷  
 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。

2.场内发售机构

(1)本基金的场内发售机构为具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位(具体名单可在深交所网站查询)。

(2)本基金募集结束前获得基金销售资格的深交所会员单位可新增为本基金的场内发售机构。

(二)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:010-50938782  
 传真:010-50938907  
 负责人:赵亦清  
 (三)律师事务所

名称:上海通力律师事务所  
 住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
 法定代表人:俞卫锋  
 办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
 联系电话:021-31359666  
 传真:021-31359600  
 联系人:陈毓华  
 经办律师:黎明、孙晔

(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号展银银行大厦6楼  
 法定代表人:李丹  
 办公地址: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:黄佳亮  
 经办会计师:许康祺、陈嘉

四、基金名称

本基金名称:鹏华中证800地产指数分级证券投资基金

五、基金运作方式及类型

契约开放式,股票型证券投资基金

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,力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。

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,包括标的指数成份股及其备选成份股(含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市股票)、债券、股指期货、权证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(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的90%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。

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。

八、基金的投资策略

本基金采用被动式指数化投资策略,按照成份股在标的指数中的基准权重构建复制投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整或成份股发生增发、分红等行为时,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流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可对投资组合管理进行适当调整,力求降低跟踪误差。

本基金力争华地地产份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过±0.35%,年跟踪误差率不超过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、股票投资策略

(1)股票投资组合的构建

本基金在建仓期内,将按照标的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法,以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时,本基金可以根据市场情况,结合分析判断,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标的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投资比例限制、申购赎回变动情况等变化,对其进行适时调整,以保证鹏华地产份额净值增长率与标的指数收益增长率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,如发现流动性欠缺的个股将可能采用合理方法替代。由于受到各项标的限制,基金可能无法按照成份股的权重持有成份股,基金将采用合理方法进行替代。

2、不定期调整

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。

3、不定期调整

根据最新编制规则,当标的指数的成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时,本基金将根据各成份股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,本基金可以对投资组合管理进行适当调整,力求降低跟踪误差。

2.股指期货投资策略

本基金将以套期保值策略为主,进行套期保值。

3.股指期货、权证等投资策略

本基金可投资股指期货、权证和其他中国证监会允许的金融衍生产品。

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,降低申购赎回现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本,达到稳定投资组合资产净值的目的。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报批董事会审批。

本基金通过权证投资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投资的合理估值水平,追求稳定的当期收益。

九、基金的业绩比较基准

中证800地产指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%

中证800地产指数从中证900指数样本中挑选属于地产行业的公司股票组成样本股,可以综合反映沪深两市属于地产行业的公司股票的整体走势,同时为投资者提供新的投资标的。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金管理人可以在取得基金托管人同意后变更业绩比较基准,不需要召集基金份额持有人大会,但需报中国证监会备案并对外公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

从本基金所分拆的两类基金份额来看,鹏华地产A份额为稳健收益类份额,具有低风险且预期收益相对较高的特征;鹏华地产B份额为积极收益类份额,具有高风险且预期收益相对较高的特征。

十一、基金的投资组合报告

基金管理人及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责任。

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2019年10月24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。  
 本报告期为2019年7月1日起至2019年9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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	344,393,364.69	94.93
2	债券投资	344,393,364.69	94.93
3	应收利息	-	-
4	其他资产	-	-
5	其他负债	-	-
6	公允价值变动资产	-	-
7	持有待售金融资产	-	-
8	资产减值准备	-	-
9	合计	344,393,364.69	94.93

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

(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	行业名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	医药	-	-
C	制造业	2,947,009.09	0.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储和邮政业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	金融业	344,393,364.69	94.93
I	房地产业	-	-
J	批发和零售业	-	-
K	住宿和餐饮业	-	-
L	居民服务、修理和其他服务业	-	-
M	教育、文化和体育产业	-	-
N	综合	344,393,364.69	94.93

(2)报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	医药	-	-
C	制造业	2,947,009.09	0.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储和邮政业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	金融业	344,393,364.69	94.93
I	房地产业	-	-
J	批发和零售业	-	-
K	住宿和餐饮业	-	-
L	居民服务、修理和其他服务业	-	-
M	教育、文化和体育产业	-	-
N	综合	344,393,364.69	94.93

(3)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合:无。

(4)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(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	深发展A	3,711,361	63,072,403.30	14.60
2	000004	万邦A	1,983,943	50,344,075.00	13.09
3	000030	中信证券	898,790	26,265,402.00	6.65
4	000019	招商证券	3,226,780	22,425,000.00	5.64
5	000009	新华保险	2,133,350	14,966,000.00	3.72
6	000033	荣泰发展	1,179,254	13,567,407.00	3.37
7	000066	保利地产	1,898,301	13,461,000.00	3.29
8	001918	招商公路	460,497	12,121,750.00	3.05
9	002329	润兴股份	908,497	7,488,000.00	1.88
10	000010	中国平安	364,502	7,404,530.52	1.86

(2)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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	000012	国信证券	12,280	1,204,000.00	0.29
2	001101	顺鑫农业	7,047	776,404.00	0.17
3	000033	荣泰发展	21,491	497,042.00	0.12
4	000021	招商蛇口	12,320	146,074.00	0.04
5	000018	华联控股	2,261	29,290.00	0.01

3.报告期末按债券品种和分类的债券投资组合

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

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

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

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

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:无。

(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,降低申购赎回现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本,达到稳定投资组合资产净值的目的。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货交易投资情况

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货交易。

(2)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国债期货交易。

(3)本期国债期货交易评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货交易。

11.投资组合报告附注

(1)

中国建设 2019年3月2日,深交所出具《关于对江苏中南建设集团股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分决定》,具体内容如下:

当事人:

江苏中南建设集团股份有限公司,住所:江苏省南通市常乐镇;陈锦石,江苏中南建设集团股份有限公司董事长兼总经理;钱军,江苏中南建设集团股份有限公司时任财务总监;

毕琦,江苏中南建设集团股份有限公司董事;

张伟,江苏中南建设集团股份有限公司时任董事会秘书。

经查明,江苏中南建设集团股份有限公司(以下简称“中南建设”)及相关当事人存在以下违规行为:

2017年11月11日,中南建设与深圳和顺达投资有限公司(以下简称“深圳和顺达”)、深圳三福房地产开发有限公司(以下简称“深圳三福”)签署《深圳市罗湖区草埔城中村城市更新项目合作协议》,中南建设与深圳三福分别持有中南(深圳)房地产开发有限公司(以下简称“中南地产”)47%和20%的股权,转让与深圳和顺达。2017年11月16日,中南建设完成了转让中南地产47%股权转让的工商变更登记。2017年12月8日,中南建设收到交易方深圳和顺达支付的股权转让款。本次交易产生的投资收益共计金额为90,100万元,此次交易在扣除所得税影响后,股权转让产生的净利润为37,367万元,占中南建设2016年度归母净利润的92.16%。对于上述重大交易事项,中南建设迟至2018年8月7日才履行信息披露义务,并迟至2019年1月17日才履行股东大会审议程序。

中南建设上述行为违反了《股票上市规则(2014年修订)》第21条、第7.3条、第9.3.3条的规定和本所《股票上市规则(2018年11月修订)》第21条、第7.3条、第9.3.3条的规定。中南建设董事长兼总经理陈锦石、时任财务总监钱军未恪尽职守,履行诚信勤勉义务,违反了本所《股票上市规则(2014年修订)》第14条、第3.1.5条的规定和本所《股票上市规则(2018年11月修订)》第1.4条、第3.1.5条的规定,对中南建设上述违规行为负有重要责任。

中南房地产公司工作人员于该次股权转让前向中南房地产公司时任高级副总裁、中南建设现任董事李琦提供了本次股权转让的相关资料。李琦自2018年5月18日起任中南建设董事,其知悉中南建设上述违规行为,但未恪尽职守、履行诚信勤勉义务,违反了本所《股票上市规则(2018年11月修订)》第1.4条、第3.1.5条的规定,对中南建设上述违规行为负有重要责任。

中南建设时任董事会秘书张伟于未恪尽职守,履行诚信勤勉义务,违反了本所《股票上市规则(2014年修订)》第1.4条、第3.1.5条、第3.2.2条和本所《股票上市规则(2018年11月修订)》第1.4条、第3.1.5条和第3.2.2条的规定,对中南建设上述违规行为负有重要责任。

鉴于上述违规事实及情节,依据本所《股票上市规则(2018年11月修订)》第17.2条、第17.3条和第17.4条的规定,经本所纪律处分委员会审议通过,本所作如下处分决定:

一、对江苏中南建设集团股份有限公司给予通报批评的处分。

二、对江苏中南建设集团股份有限公司董事长兼总经理陈锦石、时任财务总监钱军、现任董事李琦、时任董事会秘书张伟给予通报批评的处分。

对于江苏中南建设集团股份有限公司及相关当事人的上述违规行为及本所给予的处分,本所将记入上市公司诚信档案,并向社会公开。

对上述股票的投资决策程序说明:本基金为指数基金,为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份股的权重进行配置,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,符合法律法规和公司制度的规定。

(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备选库。

(3)其他资产构成

序号	资产名称	金额(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	应收利息	94,200.00	0.02
2	应收股利	699,330.00	0.18
3	应收申购款	-	-
4	其他应收款	4,100.00	0.00
5	其他流动资产	107,670.00	0.03
6	其他长期资产	-	-
7	其他资产	-	-
8	负债	-	-
9	合计	1,405,230.00	0.36

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:无。

(5)报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:无。

(6)报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限原因
1	000012	国信证券	1,204,000.00	0.29	非流通股
2	001101	顺鑫农业	776,404.00	0.17	非流通股
3	000033	荣泰发展	497,042.00	0.12	非流通股
4	000021	招商蛇口	146,074.00	0.04	非流通股
5	000018	华联控股	29,290.00	0.01	非流通股

(7)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,投资组合持仓中证券之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的投资

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表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金基金合同生效以来的投资业绩与同期基准的比较如下表所示(本报告中所列财务数据未经审计):