

B084 信息披露 | Disclosure

(上接B083版)

网址:www.swsc.com.cn
30) 湘财证券销售有限公司
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:96361
网址:www.xcsc.com
31) 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:96321
网址:www.cindasc.com
32) 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—46层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—46层
法定代表人:肖少林
联系人:林生迎
客户服务电话:96566
网址:www.newone.com.cn
33) 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
34) 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:胡剑
客户服务电话:40088-96618
网址:www.e6618.com
35) 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:4008-888-888/96551
网址:www.chinastock.com.cn
36) 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:96532/4006080008
网址:www.china-invs.cn
37) 中泰证券股份有限公司
注册地址:济南市市中区经七路96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:96538
网址:www.zts.com.cn
38) 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188号
法定代表人:王常青
联系人:刘畅
客户服务电话:96587/4008-888-108
网址:www.csc108.com
39) 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:郑楚
客户服务电话:96548
网址:http://sdclitics.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号上站大楼平衡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:彭文涛
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1301-1306、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1301-1306、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:96056
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:戚晓强
客户服务电话:400-159-9288
网址:danjuanapp.com
3) 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
4) 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:96118
网址:fund.jd.com
5) 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
6) 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:韩爱华
客户服务电话:4000-766-123
网址:www.fund123.com
7) 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:96177
网址:www.snjijin.com
8) 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
客户服务电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com
9) 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
10) 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410号
办公地址:上海市浦东新区南路1118号鄂尔多斯大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
联系人:王诗琦
客户服务电话:400-700-9666
网址:www.howbuy.com
11) 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
12) 上海煜基基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇浦银路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.jiyifund.com.cn
13) 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
14) 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
15) 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:胡燕燕
联系人:李莉
客户服务电话:021-50810673
网址:www.wacaijijin.com
16) 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:徐亚宇
客户服务电话:400-799-1888
网址:www.520fund.com.cn
17) 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:吴强
客户服务电话:4008773772
网址:www.5ifund.com
19) 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:020-89623066
网址:www.yingmi.com
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、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
办公室地址: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、出具法律意见书的律师事务所
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
办公室地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
联系电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:黎明、陈颖华
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
经会计师:许康伟、陈熹

第四部分 基金的名称

本基金名称:鹏华中证医药卫生指数证券投资基金(LOF)

第五部分 基金的运作方式和类型

契约型开放式,指数型基金

第六部分 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。

第七部分 基金的投资范围

本基金投资范围为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的股票)、债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券以及法律法规或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,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:投资于股票部分的比例不低于基金资产的80%,其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的90%;每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,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。

第八部分 基金的投资策略

本基金采用被动式指数化投资方法,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。

当预期成份股发生调整或成份股发生配股、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,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。

本基金力争基金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,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指数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,结合研究分析,对基金财产进行适当调整,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的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,对其进行适时调整,以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率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,如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制,基金可能不能按照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对备选股票的预期,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,当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时,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变通和调整,力求降低跟踪误差。

2、债券投资策略

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。

3、衍生品投资策略

本基金可投资股指期货、权证和其他经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,降低申购赎回时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董事会批准。

本基金通过对权证证券基本面的研究,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的合理估值水平,追求稳定的当期收益。

第九部分 基金的业绩比较基准

中证医药卫生指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%

中证医药卫生指数是中证行业指数之一,由中证800指数中归属于医药卫生行业的公司股票组成,反映了沪深A股医药卫生行业公司股票的整体表现,并作为指数化产品提供新的标的指数。

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及时公告。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金,具有与标的指数相似的风险收益特征。

第十一部分 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。

基金托管人中国建设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	62,889,377.77	90.64
2	其中:股票	62,889,377.77	90.64
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	-	-
5	其中:国债	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	金融衍生品投资	-	-
9	买入返售金融资产	-	-
10	其中:买入返售金融资产-银行承兑票据	-	-
11	银行存款和结算备付金合计	3,602,479.00	6.37
12	其他资产	62,048.27	0.09
13	合计	66,542,905.04	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

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	41,968,944.03	76.09
D	电力、热力、燃气及水供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,179,143.38	9.27
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	897,726.03	1.61
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	701,718.00	1.28
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、医药和医疗器械制造业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生健康业	4,150,676.24	7.63
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	62,889,377.77	94.66

(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。

(3) 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	600276	恒瑞医药	82,718	8,469,388.00	9.77
2	000661	长春高新	6,000	2,220,000.00	2.59
3	000528	广明国际	26,869	2,116,968.00	2.49
4	300035	麦迪药业	60,862	4,872,528.14	5.66
5	300342	沃森生物	60,000	1,701,000.00	2.00
6	600436	片仔癀	14,700	4,600,480.00	5.35
7	002422	科伦药业	42,200	1,264,680.00	1.48
8	600527	华三生物	41,000	1,261,914.00	1.48
9	600198	生物股份	48,100	1,242,204.00	1.45
10	602503	药康生物	62,500	1,233,341.00	1.44

(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

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,降低申购赎回时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) 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的《基金招募说明书》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《基金招募说明书》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《基金招募说明书》尚未包含国债期货投资。

11、投资组合报告附注

(一)

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。

(二)

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。

(三) 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	6,994.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	716.63
5	应收申购款	44,334.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,046.27

(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

注:无。

(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,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第十二部分 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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金招募说明书。

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:(本报告中列列财务数据未经审计):

	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准标准差	1-3	2-4
2019年04月17日(基金合同生效日)至2019年12月31日	5.80%	1.17%	-5.04%	2.61%	10.00%	-1.34%
2019年01月01日至2019年12月31日	-16.61%	1.58%	-11.03%	1.97%	-5.12%	0.01%
2017年01月01日至2017年12月31日	11.26%	0.72%	13.08%	0.77%	-1.97%	-0.01%
2016年01月01日至2016年12月31日	-24.31%	1.61%	-24.71%	1.61%	0.04%	0.00%
2015年01月01日至2019年12月31日	16.30%	1.63%	16.60%	1.64%	-0.40%	-0.01%
自基金合同生效日至2019年06月30日	-13.36%	1.38%	-16.42%	1.56%	3.06%	-0.17%

第十三部分 基金的费用与税收