鹏华中证银行指数分级证券投资基金 2019 年第 4 季度报告

2019年12月31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

报告送出日期: 2020年1月20日

§1 重要提示

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 2020 年 01 月 17 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏华银行分级
场内简称	银行指基
基金主代码	160631
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月17日
报告期末基金份额总额	4, 214, 077, 938. 16 份
	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
投资目标	内。
	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
投资策略	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。本基金力争鹏华银行份额净值增长率与同期业基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%,年跟踪误差 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟置度、跟踪误差进一步扩大。 中证银行指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(移 5% 本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险	不超过 和跟踪 宗偏离 上后)×				
4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟置度、跟踪误差进一步扩大。 中证银行指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(利益)。 业绩比较基准 本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型	和跟踪 宗偏离 点后)× 型基金、				
误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟置度、跟踪误差进一步扩大。 中证银行指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(移业绩比较基准 5% 本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型	宗偏离 总后)× 型基金、				
度、跟踪误差进一步扩大。 中证银行指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(移业绩比较基准 5% 本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型	点后)×				
中证银行指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(利益) 上线比较基准 5% 本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型	型基金、				
业绩比较基准 5% 本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型	型基金、				
本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型					
债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险	. ++ 				
	、牧局				
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,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风	险收益				
风险收益特征					
基金管理人 鹏华基金管理有限公司	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					
下属分级基金的基金简称 鹏华银行分级 鹏华银行 A 鹏华银	亍 B				
下属分级基金的场内简称 银行指基 银行 A 银行	В				
下属分级基金的交易代码 160631 150227 15022	8				
报告期末下属分级基金的份 1,691,911,685.00 1,691,911,	685. 00				
额总额 830, 254, 568. 16 份 份					
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 鹏华银行 A 份额为稳 鹏华银行 B 化	分额为积				
下属分级基金的风险收益特 金,为证券投资基金中 健收益类份额,具有 极收益类份额	颁, 具有				
征 较高风险、较高预期收 低风险且预期收益 高风险且预	期收益				
益的品种。同时本基金 相对较低的特征。 相对较高的	特征。				
为指数基金,通过跟踪					
标的指数表现,具有与					
标的指数以及标的指数					

所代表的公司相似的风	
险收益特征。	

注:无。

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年10月1日-2019年12月31日)
1. 本期已实现收益	60, 009, 671. 29
2. 本期利润	279, 428, 999. 33
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0646
4. 期末基金资产净值	4, 177, 725, 350. 20
5. 期末基金份额净值	0. 991

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率	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
过去三个月	6. 24%	0.81%	6. 71%	0. 82%	-0.47%	-0.01%

注:业绩比较基准=中证银行指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%

3. 2. 2 自基金合同生效以来基金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



注: 1、本基金基金合同于 2015 年 04 月 17 日生效。2、截至建仓期结束,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注:无。

§ 4 管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

44 K7	职务	任本基金的基金经理期限		17.4.11.11.15.79	2본 미미
姓名	駅 分	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
崔俊杰	本基金基金 经理	2015-04-17	2019–11–20	11 年	崔筃理年业年华限产品化资员产化现条等。 如年华限产品化资,品研生生,,金司规计衍量先设究量,划师生化后计工化,管11从8鹏有任产量投究事量,征从

总经理、基。经理、2013 03 月至 2013 14			
经理。2013 03 月至 2015 年 11 月担任			生品投资部副
03 月至 2018 年 11 月担任			总经理、基金
年 11 月担任 關 年 深 证 民 至 至 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2			经理。2013年
關學深证民 ETF 基金基 经理, 2013 03 月至 2019 年 11 月担任 哪學深述基 基金经理, 2013 年 03 月 至 2019 年 1 月担任哪华 证民金 50ET 联接基金基 终理, 2013 03 月至 2019 年 11 月担任 民金 ETF 基 基金经理, 2013 2013 年 07 月 至 2018 年 0 月担任哪华 深分级基金金全 全经型, 2014 2014 年 12 月 至 2019 年 1 月担任哪华 深分级基金金 全经理, 2015 年 12 月至 2019 年 11 月 担任哪年 源分级基金金 全经理, 2015 04 月至 2019 年 11 月担任 哪华银行分 基金基金全 理, 2015 04 月至 2019 年 11 月担任			03月至 2019
ETF 基金基金经理,2013 03 月至 2019 年 11 月和任 聯华深证民会 基金经理,2013 年 03 月至 2019 年 1 月担任金 50 ETF 联接基金 经理,2013 03 月至 2019 年 11 月担任 民企 ETF 基金经理,2013 04 月至 2018 年 11 月担任 民企 ETF 基金经理,2013 年 07 月至 2018 年 0 月和任 邮华。 深 30 经 是 2014 年 12 月至 2019 年 1 月担任 哪年。 测分级基金 金经理,2014 年 12 月至 2019 年 11 月担任 哪年。 分级基金基型,2015 年 11 月担任 哪年。 分级基金基型,2015 年 11 月担任 哪年。 分级基金基型,2015 年 11 月担任 哪年。 2019 年 11 月担任 哪年 11 月担任 11 月日			年 11 月担任
经理, 2013 03 月至 2015 年 11 月担任			鹏华深证民营
03 月至 2016年 11 月担任			ETF 基金基金
年 11 月担任 鹏华深证民。			经理,2013年
鹏华深证民 ETF 联接基金 基金给理, 2013 年 03 月 至 2019 年 1 月担任鹏华 证民金 50ET 联接基金基。 经理, 2013 03 月至 2016 年 11 月担任 民金 ETF 基。 基金经理, 2013 年 07 月 至 2018 年 0 月担任鹏华。 深 3300ETF 章 企基金经理, 2014 年 12 月 至 2019 年 1 月担任鹏华。 源分级基金基。 金经理, 2015 年 12 月至 2019 年 11 月 担任鹏华。 初级基金基。 经理, 2015 04 月至 2016 年 11 月里日 邮华银子分。 基金基金经理, 2015 04 月至 2016 年 11 月担任			03 月至 2019
ETF 联接基金基基金经理,2013 年 03 月至 2019 年 1 月担任哪华证民金基金经理,2013 03 月至 2016 年 11 月担任 民金 ETF 基基金 经理,2013 年 07 月至 2018 年 07 月至 2018 年 07 月至 2018 年 07 月至 2019 年 1 月担任 哪华第 源分级基金经理,2014 年 12 月至 2019 年 11 月担任哪华的分级基金基金经理,2015 年 17 月至 2016 年 11 月担日 哪华申传为公司,2015 年 11 月担日 明华申传为公司,2015 年 11 月担日 明华申传为公司,2015 年 11 月担日 明华申传为公司,2015 年 11 月担日 明华申传办分量基金基金经理,2015 年 11 月担日 明华申传办分量基金基金经理,2015 年 1 月至 2016			年 11 月担任
基金经理, 2013年03月至2019年1月担任鹏华证民企 50ET 联接基金基金 经理, 2013 年07月至2018年1月担任鹏华深 300ETF 基基金经理, 2014年12月至2014年12月至2014年12月至2019年1月担任鹏华流分级基金。企经理, 2016年12月至11月担任鹏华传动 发基金基金经理, 2015年1月月至2016年11月担任鹏华传动 发基金基金经理, 2015年1月月担任鹏华传动 发基金基金经理, 2015年1月月担任鹏华传动 法金基金经理, 2015年1月月1日			鹏华深证民营
2013年03月至2019年1月担任鹏华。证民企 50ET 联接基金基: 经理,2013 03月至2016年11月担任配合、在 ETF 基基金经理,2013年07月至2018年0月担任鹏华。深 300ETF 基金基金经理,2014年12月至2019年1月担任鹏华。源分级基金企理,2019年1月至1月担任鹏华。原分级基金基:经理,2015年1月至2019年11月担任鹏华传为分级基金基:经理,2015年1月至2016年11月至11月至11月至11月至11月至11月至11月至11月至11月至11月			ETF 联接基金
至 2019 年 1 月担任鹏华。证民企 50ET 联接基金基金经理,2013 03 月至 2019 年 11 月担任 民企 ETF 基基基金经理,2013 年 07 月至 2018 年 0 月担任鹏华。深 300ETF 基金基金经理,2014 年 12 月至 2019 年 1 月担任鹏华。源分级基金金经理,2015 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华传纳分级基金基金经理,2015 04 月至 2018 年 11 月担任 鹏华传纳分级基金基金经理,2015 年 11 月担任 鹏华银行分据金基金经理,2015 年 1月 月担任 鹏华银行分据金基金经理,2015 年 1月 至 2016 年 1月			基金经理,
月担任鹏华 证民企 50ET 联接基金基。 经理,2013 03 月至 2015 年 11 月担任 民企 ETF 基。 基金经理, 2013 年 00 月担任鹏华。 深 300ETF 基。 金基金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 1 月担任鹏华。 源分级基金金。 金经理,2015 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华传办分级基金基。 经平,2015 04 月至 2018 年 11 月担任鹏华银行分。 基金基金经理,2015 年 11 月担任鹏华银行分。 基金基金经理,2015年, 月至 2016 年			2013年03月
证民企 50ET 联接基金基: 经理, 2013 03 月至 2019 年 11 月担任 民企 ETF 基: 基金经理, 2013 年 07 月至 2018 年 0 月担任鹏华滨深 300ETF 表。基金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 1 月担任鹏华滨源分级基金基。金经理, 2015 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华传沙级基金基。经理, 2015 年 11 月担任鹏华传沙级基金基。经理, 2015 年 11 月担任 鹏华银行分。基金基金经理, 2015 年 11 月担任 鹏华银行分。基金基金经理, 2015 年 1月至 2016 年			至 2019 年 11
联接基金基: 经理, 2013 03 月至 2015 年 11 月担任民企 ETF 基: 基金经理, 2013 年 07 月至 2018 年 0 月担任鹏华、深 300ETF 4 金基金经理, 2014 年 12 月至 2019 年 1 月担任鹏华、源分级基金金金金建理, 201年 12 月至 2019 年 11 月担任熙华传,分级基金基。经理, 2015 年 11 月担任熙华传,分级基金基。经理, 2015 年 11 月担任鹏华银行分。基金基金经理, 2015 年 月至 2016 年 11 月担任			月担任鹏华上
经理, 2013 03 月至 2019 年 11 月担任 民企 ETF 基: 基金经理, 2013 年 07 月 至 2018 年 0 月担任鹏华; 深 300ETF 基 金基金经理, 2014 年 12 月 至 2019 年 1 月担任鹏华; 源分级基金基。金经理, 201 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华传 分级基金基。经理, 2015 04 月至 2015 年 11 月担任 鹏华银行分线基金基。经理, 2015 年 11 月担任			证民企 50ETF
03 月至 2016 年 11 月担任 民企 ETF 基。 基金经理, 2013 年 07 月 至 2018 年 0 月担任鹏华; 深 300ETF 基 金基金经理, 2014 年 12 月 至 2019 年 1 月担任鹏华; 源分级基金基。 金经理,2015 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华传, 分级基金基。 经理,2015 04 月至 2016 年 11 月担任 鹏华银行分。 基金基金经 理,2015 年 月至 2016 年			联接基金基金
年 11 月担任 民企 ETF 基 基金经理, 2013 年 07 月 至 2018 年 0 月担任鹏华。 深 300ETF 基 金基金经理, 2014 年 12 月 至 2019 年 1 月担任鹏华。 源分级基金金。 金经理,2015 年 12 月至 2019 年 11 月 担任鹏华传, 分级基金基。 经理,2015 04 月至 2016 年 11 月担任 鹏华银行分。 基金基金经 理,2015 年 月至 2016 年			经理,2013年
民企 ETF 基金经理,2013 年 07 月至 2018 年 0 月担任鹏华泽深 300ETF 基金基金经理,2014 年 12 月至 2019 年 1 月担任鹏华泽源分级基金全理,2016 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华传办 分级基金基结 经理,2015 04 月至 2016 年 11 月担任鹏华保护 分级基金基金经理,2015 年 1月 月担任 鹏华银行分线基金基金经理,2015 年 月至 2016 年 月至 2016 年 月至 2016 年			03 月至 2019
基金经理, 2013年07月至2018年0月担任鹏华流深300ETF基金基金经理, 2014年12月至2019年1月担任鹏华流源分级基金基金经理, 2015年11月担任鹏华传统分级基金基金经理, 2015年11月担任鹏华银行分线基金基金经理, 2015年1月担任鹏华银行分线基金基金经理, 2015年1月至2016年			年 11 月担任
2013年07月至2018年0月担任鹏华泽深300ETF基金基金经理,2014年12月至2019年1月担任鹏华泽源分级基金经理,2019年11月担任鹏华禄分级基金基。经理,2015年11月担任鹏华银行分经基金基金经理,2015年1月担任			民企 ETF 基金
至 2018 年 0 月担任鹏华泽 深 300ETF 基金基金经理, 2014 年 12 月 至 2019 年 1 月担任鹏华泽 源分级基金金经理, 2015 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华禄 分级基金基金经理, 2015 年 11 月担任 鹏华银行分经基金基金经理, 2015 年 月至 2016 年 月至 2016 年			基金经理,
月担任鹏华 深 300ETF 基 金基金经理, 2014 年 12 月 至 2019 年 1 月担任鹏华 源分级基金 金经理, 201 年 12 月至 2019 年 11 月 担任鹏华传 分级基金基。 经理, 2015 04 月至 2015 年 11 月担任 鹏华银行分约 基金基金经 理, 2015 年, 月至 2016 年			2013年07月
深 300ETF 基金基金经理, 2014年12月至 2019年1月担任鹏华贵源分级基金金经理, 201年12月至 2019年11月担任鹏华传办分级基金基金经理, 2015 04月至 2015年11月担任鹏华银行分线基金基金经理, 2015年1月担任鹏华银行分线基金基金经理, 2015年1月至 2016年			至 2018 年 02
金基金经理, 2014年12月至2019年1月担任鹏华清源分级基金金经理, 201年12月至2019年11月担任鹏华传办分级基金基金经理, 2015年11月担任鹏华银行分约基金基金经理, 2015年1月担任鹏华银行分约基金基金经理, 2015年1月至2016年			月担任鹏华沪
2014年12月至2019年1月担任鹏华3源分级基金金金理,2019年11月担任鹏华64分级基金基金经理,201504月至2019年11月担任鹏华银行分约基金基金经理,2015年11月担任鹏华银行分约基金基金经理,2015年1月至2016年			深 300ETF 基
至 2019 年 1 月担任鹏华强 源分级基金金金经理, 2016 年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华传统 分级基金基金经理, 2015 04 月至 2015 年 11 月担任鹏华银行分级基金基金经理, 2015 年 11 月担任 鹏华银行分级基金基金经理, 2015 年 1月至 2016 年			金基金经理,
月担任鹏华子 源分级基金 金经理,201 年 12 月至 2019 年 11 月 担任鹏华传 分级基金基。 经理,2015 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分。 基金基金经 理,2015 年 月至 2016 年			2014年12月
源分级基金经理,2015年11月担任鹏华传统分级基金基金经理,2015年11月担任鹏华银行分约基金基金经理,2015年11月担任鹏华银行分约基金基金经理,2015年1月至2016年			至 2019 年 11
金经理,201年 12 月至 2019年 11 月 担任鹏华传统 分级基金基金经理,2015 04 月至 2015年 11 月担任鹏华银行分约基金基金经理,2015年 月至 2016年			月担任鹏华资
年 12 月至 2019 年 11 月担任鹏华传统 分级基金基金 经理,2015 04 月至 2019 年 11 月担任鹏华银行分级基金基金经理,2015 年 11 月担任鹏华银行分级基金基金经理,2015 年 月至 2016 年			源分级基金基
2019年11月 担任鹏华传统 分级基金基金 经理,2015 04月至2019 年11月担任 鹏华银行分约 基金基金经 理,2015年 月至2016年			金经理,2014
担任鹏华传统分级基金基金经理,2015 04 月至 2016 年 11 月担任鹏华银行分级基金基金经理,2015 年 1月至 2016 年			年 12 月至
分级基金基金经理, 2015 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分约 基金基金经 理, 2015 年 月至 2016 年			2019年11月
经理,2015 04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分约 基金基金经 理,2015 年 月至 2016 年			担任鹏华传媒
04 月至 2019 年 11 月担任 鹏华银行分约 基金基金经 理, 2015 年 月至 2016 年			分级基金基金
年 11 月担任 鹏华银行分约 基金基金经 理, 2015 年 月至 2016 年			经理,2015 年
勝华银行分類基金基金经理, 2015 年 月至 2016 年			04月至 2019
基金基金经 理,2015年 月至 2016年			年 11 月担任
理, 2015 年 月至 2016 年			鹏华银行分级
月至 2016 年			基金基金经
			理, 2015年 08
07 月担任鹏			月至 2016 年
		 	 07月担任鹏华

					医药分级基金
					基金经理,
					2016年07月
					至 2019 年 11
					月担任鹏华医
					药指数 (LOF)
					基金基金经
					理,2016年11
					月至 2019 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。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,增聘闫冬
					为本基金基金
					经理, 崔俊杰
					不再担任本基
					金基金经理。
					闫冬先生,国
					籍中国,理学
					硕士,9年证
					券基金从业经
					验。曾任招商
					期货有限公司
					资产管理部投
	本基金基金				资经理; 2018
闫冬	华	2019-11-20	_	9年	年5月加盟鹏
	汇生				华基金管理有
					限公司,现任
					量化及衍生品
					投资部基金经
					理。2019年03
					月担任鹏华信
					息分级基金基
					金经理,2019

		年 03 月担任
		鹏华环保分级
		基金基金经
		至立至立红 理,2019年03
		· ·
		月担任鹏华酒
		分级基金基金
		经理,2019年
		04月担任鹏华
		地产分级基金
		基金经理,
		2019年11月
		担任鹏华银行
		分级基金基金
		经理,2019年
		11 月担任鹏华
		资源分级基金
		基金经理。闫
		冬先生具备基
		金从业资格。
		本报告期内本
		基金基金经理
		发生变动,增
		聘闫冬为本基
		金基金经理,
		崔俊杰不再担
		任本基金基金
		经理。
		~

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 管理人对报告期内本基金运作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人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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,本基金未发生违法违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 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,基金运作严格按照基金合同的各项要求,依据被动化指数投资方法进行投资管理。

报告期内,基金日均跟踪偏离度和跟踪误差都有较好的控制,较好地实现了基金运作目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期末,基金份额单位净值为 0.991,累计单位净值为 1.096。本报告期基金份额净值增长率为 6.24%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3, 949, 541, 933. 21	93. 89
	其中: 股票	3, 949, 541, 933. 21	93. 89
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	236, 040, 864. 95	5. 61
8	其他资产	20, 965, 796. 54	0. 50
9	合计	4, 206, 548, 594. 70	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	_	-
В	采矿业	_	_
С	制造业	_	_
D	电力、热力、燃气及水生产和 供应业	_	_
Е	建筑业	_	_
F	批发和零售业	_	-
G	交通运输、仓储和邮政业	_	-
Н	住宿和餐饮业		_
Ι	信息传输、软件和信息技术服 务业	_	_
J	金融业	3, 939, 455, 280. 57	94. 30
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	_	_
N	水利、环境和公共设施管理业		_
0	居民服务、修理和其他服务业	_	_
Р	教育	_	_
Q	卫生和社会工作	_	_
R	文化、体育和娱乐业	_	_
S	综合	-	_
	合计	3, 939, 455, 280. 57	94. 30

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	_	_
В	采矿业	_	_
С	制造业	2, 049, 880. 02	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和		
D	供应业	_	_
Е	建筑业	_	_
F	批发和零售业	_	_
G	交通运输、仓储和邮政业	_	_
Н	住宿和餐饮业	_	_
I	信息传输、软件和信息技术服		
1	务业	143, 642. 10	_
J	金融业	7, 886, 552. 48	0. 19
K	房地产业	_	_
L	租赁和商务服务业	<u> </u>	_
M	科学研究和技术服务业	<u> </u>	_
N	水利、环境和公共设施管理业	6, 578. 04	_

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
Р	教育		_
Q	卫生和社会工作	_	_
R	文化、体育和娱乐业	_	_
S	综合	_	_
	合计	10, 086, 652. 64	0. 24

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:无。

5.3 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股票投资明细

5.3.1 报告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

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	15, 724, 187	590, 914, 947. 46	14. 14
2	601166	兴业银行	25, 262, 080	500, 189, 184. 00	11. 97
3	000001	平安银行	16, 855, 828	277, 278, 370. 60	6.64
4	600016	民生银行	43, 123, 059	272, 106, 502. 29	6. 51
5	601328	交通银行	47, 730, 354	268, 721, 893. 02	6. 43
6	600000	浦发银行	20, 395, 982	252, 298, 297. 34	6.04
7	601288	农业银行	66, 550, 579	245, 571, 636. 51	5.88
8	601398	工商银行	37, 469, 343	220, 319, 736. 84	5. 27
9	601169	北京银行	25, 710, 566	146, 036, 014. 88	3. 50
10	002142	宁波银行	4, 888, 678	137, 616, 285. 70	3. 29

5.3.2 报告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

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	601658	邮储银行	1, 132, 268	6, 515, 603. 78	0. 16
2	601916	浙商银行	294, 195	1, 370, 948. 70	0.03
3	688020	方邦股份	7, 643	678, 698. 40	0.02
4	688199	久日新材	4, 494	268, 112. 04	0.01
5	688101	三达膜	13, 483	241, 210. 87	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:无。

5.5 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。

5.6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。

- 5.7 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。
- 5.8 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。
- 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期内未发生股指期货投资。

5.9.2 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。

- 5. 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- 5.10.1 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。

- 5.10.2 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。
- 5.10.3 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。

- 5.11 投资组合报告附注
- 5.11.1 本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内受到公开谴责、处罚的情形。

交通银行

2019年12月24日江苏证监局公告对交通银行股份有限公司江苏省分行采取责令改正的的行

政监督管理措施。江苏证监局对交通银行江苏省分行进行现场检查,发现基金销售业务存在以下问题;

- 一、个金条线中多名客户经理没有基金销售资格但有基金销售记录,且获得基金销售业务收 入。
- 二、交易记录中存在基金投资人购买高于其风险承受能力基金产品的记录,但未对上述投资者进行特别的书面风险警示。
- 三、基金投资人通过交通银行手机 app 购买基金产品时,未对投资者进行风险警示,未告知 投资者适当性匹配情况。

对上述股票的投资决策程序的说明: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分股的权重进行配置,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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	436, 314. 76
2	应收证券清算款	_
3	应收股利	_
4	应收利息	50, 913. 89
5	应收申购款	20, 478, 567. 89
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	20, 965, 796. 54

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:无。

- 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
- 5.11.5.1 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。
- 5.11.5.2 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		股票名称	流通受限部分的公	占基金资产净	流通受限情况
	股票代码		允价值 (元)	值比例 (%)	说明
1	601658	邮储银行	4, 548, 460. 38	0. 11	锁定期股票
2	601916	浙商银行	1, 370, 948. 70	0.03	锁定期股票
3	688020	方邦股份	678, 698. 40	0.02	锁定期股票
4	688199	久日新材	268, 112. 04	0.01	锁定期股票
5	688101	三达膜	241, 210. 87	0.01	锁定期股票

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	鹏华银行分级	鹏华银行 A	鹏华银行 B
报告期期初基金份额总额	1, 044, 763, 550. 73	1, 795, 801, 461. 00	1, 795, 801, 461. 00
报告期期间基金总申购份额	309, 077, 637. 19	_	_
减:报告期期间基金总赎回份额	831, 811, 124. 39	_	_
报告期期间基金拆分变动份额(份额减	200 224 504 62	_102 990 776 00	-103, 889, 776. 00
少以"-"填列)	300, 224, 304. 03	-103, 889, 770.00	-103, 869, 776. 00
报告期期末基金份额总额	830, 254, 568. 16	1, 691, 911, 685. 00	1, 691, 911, 685. 00

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及定期折算、不定期折算变动的份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

注:无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

- 8.1 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。
- 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证银行指数分级证券投资基金基金合同》;
- (二)《鹏华中证银行指数分级证券投资基金托管协议》;
- (三)《鹏华中证银行指数分级证券投资基金 2019 年第 4 季度报告》(原文)。

9.2 存放地点

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。

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站(http://www.phfund.com.cn)查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司,本公司已开通客户服务系统,咨询电话: 4006788999。

鹏华基金管理有限公司 2020年1月20日