

# 鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)2018 年半年度报告

2018 年 06 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2018 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	52
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	52

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 .....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
7.12 投资组合报告附注 .....	52
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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 .....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>54</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	56
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>60</b>
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 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	鹏华中证 500 指数 (LOF)
场内简称	鹏华 500
基金主代码	160616
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2010 年 2 月 5 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	225,828,236.21 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 4 月 28 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	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,以实现了对中证 500 指数的有效跟踪。
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。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、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。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
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预期风险、较高预期收益品种。

注:无。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈
	联系电话	0755-82825720
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn
客户服务电话	4006788999	95588

传真	0755-82021126	010-66105799
注册地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	何如	易会满

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2018 年 01 月 01 日-2018 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	-5,728,270.77
本期利润	-40,985,491.36
加权平均基金份额本期利润	-0.1938
本期加权平均净值利润率	-15.16%
本期基金份额净值增长率	-15.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2018 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	30,653,112.60
期末可供分配基金份额利润	0.1357
期末基金资产净值	256,481,348.81
期末基金份额净值	1.136
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2018 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	13.60%

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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分

的期末余额的孰低数。

表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

### 3.2 基金净值表现

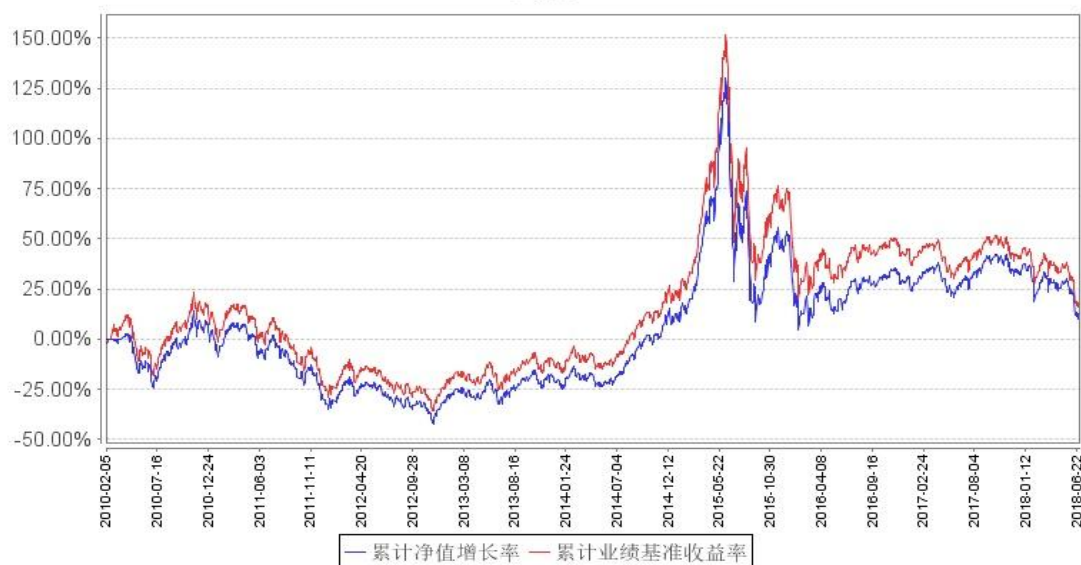
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率① (%)	份额净值 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 (%)
过去一个月	-8.46	1.75	-8.86	1.77	0.40	-0.02
过去三个月	-12.75	1.30	-13.96	1.31	1.21	-0.01
过去六个月	-15.22	1.37	-15.70	1.37	0.48	0.00
过去一年	-12.35	1.16	-14.19	1.16	1.84	0.00
过去三年	-36.89	1.93	-39.37	1.80	2.48	0.13
自基金成立 起至今	13.60	1.68	19.45	1.63	-5.85	0.05

注：业绩比较基准=中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

鹏华中证500指数 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日, 业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末, 公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.)、深圳市北融信投资发展有限公司组成, 公司性质为中外合资企业。公司原注册资本 8,000 万元人民币, 后于 2001 年 9 月完成增资扩股, 增至 15,000 万元人民币。截止 2018 年 6 月, 公司管理资产总规模达到 5,232.30 亿元, 管理 152 只公募基金、10 只全国社保投资组合、3 只基本养老保险投资组合。经过近 20 年投资管理基金, 在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

#### 4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张羽翔	本基金基金经理	2016-09-24	-	11	张羽翔先生, 国籍中国, 工学硕士, 11 年金融证券从业经验。曾任招商银行软件中心 (原深圳市融博技术公司) 数据分析



				<p>师; 2011 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任监察稽核部资深金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员, 先后从事金融工程、量化研究等工作; 2015 年 09 月担任鹏华上证民企 50ETF 联接基金基金经理 2015 年 09 月担任鹏华上证民企 50ETF 基金基金经理, 2016 年 06 月至 2018 年 05 月担任鹏华新丝路分级基金基金经理, 2016 年 07 月担任鹏华高铁分级基金基金经理, 2016 年 09 月担任鹏华沪深 300 指数 (LOF) 基金基金经理, 2016 年 09 月担任鹏华中证 500 指数 (LOF) 基金基金经理 2016 年 11 月担任鹏华新能源分级基金基金经理, 2016 年 11 月担任鹏华一带一路分级基金基金经理 2018 年 04 月担任鹏华互联网分级基金基金经理, 2018 年 04 月担任鹏华创业板分级基金基金经理, 2018 年 05 月担任鹏华钢铁分级基金基金经理, 2018 年 05 月担任鹏华香港中小企业指数 (LOF) 基金基金经理, 2018 年 05 月担任鹏华沪深 300 指数增强基金基金经理。张羽翔先生具备基金从业资格。本报告期</p>
--	--	--	--	---

					内本基金基金经理未发生变动。
--	--	--	--	--	----------------

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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金秉承指数基金的投资策略,在应对基金申购赎回的基础上,力争跟踪指数的收益,并将基金跟踪误差控制在合理范围内。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.136 元;本报告期基金份额净值增长率为-15.22%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年上半年由于贸易战与去杠杆双重冲击,A 股总体表现较差,总量上指数大幅回落,行业结构上看旅游、医药、食品等大消费类板块表现最好,风格上看创业板指略好于主板。

景气决定方向,估值决定空间。2018 年市场依然保持淡化风格、深化价值的投资理念。中美贸易争端短期虽是扰动,长期则是促进。必将加速推动了国内的产业结构升级。现阶段权益资

产已具有极佳的配置价值：无论从国际比较还是历史比较，当前 A 股整体估值均已到达底部位置。我们认为当前 A 股权益资产具有较好的投资性价比。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### (1) 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

###### (2) 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

##### 3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

##### 4. 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 30,653,112.60 元，期末基金份额净值 1.136 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在

严格遵守规定前提下, 对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内, 本基金托管人在对鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内, 鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 的管理人——鹏华基金管理有限公司在鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内, 鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 未进行利润分配。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2018 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查, 以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告 (未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体: 鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2018 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	23,080,621.15	19,409,610.76
结算备付金		-	235,763.38
存出保证金		73,389.17	62,423.95
交易性金融资产	6.4.7.2	233,603,770.92	304,203,692.35
其中: 股票投资		233,603,770.92	304,203,692.35
基金投资		-	-

债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	4,543.38	4,285.96
应收股利		-	-
应收申购款		370,746.78	285,155.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		257,133,071.40	324,200,932.11
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年6月30日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	2,225,809.59
应付赎回款		149,748.09	88,780.44
应付管理人报酬		154,201.96	186,591.07
应付托管费		30,840.42	37,318.23
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	63,208.59	197,685.05
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	253,723.53	660,117.46
负债合计		651,722.59	3,396,301.84
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	225,828,236.21	239,490,327.51
未分配利润	6.4.7.10	30,653,112.60	81,314,302.76
所有者权益合计		256,481,348.81	320,804,630.27
负债和所有者权益总计		257,133,071.40	324,200,932.11

注: 报告截止日 2018 年 06 月 30 日, 基金份额净值 1.136 元, 基金份额总额 225,828,236.21 份。

## 6.2 利润表

会计主体: 鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-39,062,795.67	6,154,398.77
1. 利息收入		68,029.20	56,578.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	68,029.20	56,578.35
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,979,690.06	8,776,063.01
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-5,568,580.68	7,297,689.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,588,890.62	1,478,373.46
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-35,257,220.59	-2,703,521.98
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	106,085.78	25,279.39
减：二、费用		1,922,695.69	1,757,944.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,000,913.85	1,020,277.43
2. 托管费	6.4.10.2.2	200,182.85	204,055.53
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	417,915.31	229,940.27
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	303,683.68	303,671.49
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-40,985,491.36	4,396,454.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-40,985,491.36	4,396,454.05

## 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	239,490,327.51	81,314,302.76	320,804,630.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-40,985,491.36	-40,985,491.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-13,662,091.30	-9,675,698.80	-23,337,790.10
其中: 1. 基金申购款	65,849,749.60	13,646,739.43	79,496,489.03
2. 基金赎回款	-79,511,840.90	-23,322,438.23	-102,834,279.13
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	225,828,236.21	30,653,112.60	256,481,348.81
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	209,606,407.20	59,253,588.47	268,859,995.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	4,396,454.05	4,396,454.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	29,347,055.83	7,084,712.42	36,431,768.25
其中: 1. 基金申购款	56,312,629.98	15,482,355.49	71,794,985.47
2. 基金赎回款	-26,965,574.15	-8,397,643.07	-35,363,217.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-

五、期末所有者权益(基金净值)	238,953,463.03	70,734,754.94	309,688,217.97
-----------------	----------------	---------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>邓召明</u>	<u>苏波</u>	<u>郝文高</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 证监许可[2009]第 1374 号《关于核准鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 募集的批复》核准, 由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,629,831,732.31 元, 业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 021 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2010 年 2 月 5 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 2,630,723,634.12 份基金份额, 其中认购资金利息折合 891,901.81 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所 (以下简称“深交所”) 深证上[2010]第 129 号文审核同意, 本基金 583,423,342.00 份基金份额于 2010 年 4 月 28 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定, 本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 中证 500 指数的成份股及其备选成份股 (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不低于基金资产净值的 5%。此外, 为更好的实现投资目标, 本基金将少量投资于非中证 500 成份股、新股 (首次发行或增发等) 以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金的业绩比较基准为: 中证 500 指数收益率 X95%+银行同业存款利率 X5%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定 (以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投



资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2018 年 06 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利

收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	23,080,621.15
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月及以上	-
其他存款	-
合计	23,080,621.15

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	274,479,982.37	233,603,770.92	-40,876,211.45
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	274,479,982.37	233,603,770.92	-40,876,211.45

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注:无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注:无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注:无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	4,513.68
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	29.70
合计	4,543.38

#### 6.4.7.6 其他资产

注:无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	63,208.59
银行间市场应付交易费用	-
合计	63,208.59

#### 6.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	409.85
指数使用费	50,000.00
预提费用	203,313.68
合计	253,723.53

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	239,490,327.51	239,490,327.51
本期申购	65,849,749.60	65,849,749.60
本期赎回 (以“-”号填列)	-79,511,840.90	-79,511,840.90
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	225,828,236.21	225,828,236.21

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	207,471,911.79	-126,157,609.03	81,314,302.76
本期利润	-5,728,270.77	-35,257,220.59	-40,985,491.36
本期基金份额交易产生的变动数	-13,179,702.55	3,504,003.75	-9,675,698.80
其中：基金申购款	55,303,777.57	-41,657,038.14	13,646,739.43
基金赎回款	-68,483,480.12	45,161,041.89	-23,322,438.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	188,563,938.47	-157,910,825.87	30,653,112.60

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	62,371.47
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,485.25
其他	3,172.48

合计	68,029.20
----	-----------

注:其他为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	149,222,491.66
减:卖出股票成本总额	154,791,072.34
买卖股票差价收入	-5,568,580.68

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注:无。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注:无。

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注:无。

##### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注:无。

##### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注:无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注:无。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注:无。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注:无。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注:无。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注:无。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注:无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,588,890.62
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,588,890.62

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位:人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-35,257,220.59
股票投资	-35,257,220.59
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减:应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-35,257,220.59

**6.4.7.18 其他收入**

单位:人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	15,721.05
转换费收入	90,364.73
合计	106,085.78

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	417,915.31
银行间市场交易费用	-
合计	417,915.31

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	370.00
指数使用费	100,000.00
上市年费	29,752.78
合计	303,683.68

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司 (“鹏华基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司 (“中国工商银	基金托管人、基金代销机构

行”)	
国信证券股份有限公司 (“国信证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
国信证券	67,216,050.54	25.25	0.00	0.00

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注:无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注:无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

注:无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总额的 比例 (%)
国信证券	62,304.80	25.42	28,485.63	45.07



关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日 至 2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣 金余额	占期末应付佣金总额的 比例 (%)
国信证券	-	-	-	-

注: (1) 佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1%-买(卖)经手费-买(卖)证管费

深圳证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1%-买(卖)经手费-买(卖)证管费

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

(2) 本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易单元租用协议》。根据协议规定, 上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6 月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,000,913.85	1,020,277.43
其中: 支付销售机构的客户维护费	236,433.45	271,895.17

注: 1、支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为 0.75%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.75%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6 月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	200,182.85	204,055.53

注: 支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费年费率为 0.15%，逐日计提，按月支付。

日托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

注:无。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注:无。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注:无。

**6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

注:本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	23,080,621.15	62,371.47	17,795,776.87	55,530.68

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注:本基金本报告期及上年度可比期间未参与关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

注:无。

**6.4.12 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

603105	芯能科技	2018年 06月29 日	2018年 07月09 日	新股流通 受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
603693	江苏新能	2018年 06月25 日	2018年 07月03 日	新股流通 受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年 06月29 日	2018年 07月09 日	新股流通 受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功 认购日	可流通 日	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位:张)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

## 6.4.12.1.3 受限证券类别：权证

证券代码	证券名称	成功 认购日	可流通 日	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位:张)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000693	*ST 华泽	2018-05-02	重大 事项	0.55	-	-	19,205	382,557.31	10,562.75	-
002359	北讯 集团	2018-05-21	重大 事项	19.58	2018-8-21	17.62	38,900	873,579.47	761,662.00	-
002477	雏鹰 农牧	2018-06-14	重大 事项	3.31	-	-	104,812	506,534.35	346,927.72	-
002512	达华 智能	2018-06-19	重大 事项	9.70	-	-	30,500	450,792.33	295,850.00	-
002005	德豪 润达	2018-01-02	重大 事项	4.36	2018-7-2	3.92	81,330	409,213.30	354,598.80	-
600811	东方 集团	2018-05-30	重大 事项	4.30	-	-	181,940	900,345.00	782,342.00	-
600086	东方 金钰	2018-01-19	重大 事项	10.04	-	-	48,722	508,302.03	489,168.88	-
002011	盾安 环境	2018-05-02	重大 事项	6.40	-	-	40,205	371,295.72	257,312.00	-
600687	刚泰 控股	2018-06-11	重大 事项	9.09	2018-8-20	8.18	26,000	354,482.05	236,340.00	-

600335	国机汽车	2018-04-03	重大事项	10.43	-	-	25,308	295,801.06	263,962.44	
000566	海南海药	2017-11-22	重大事项	12.89	2018-7-9	11.60	53,354	636,517.91	687,733.06	-
600122	宏图高科	2018-06-19	重大事项	7.40	-	-	49,882	555,261.64	369,126.80	-
600750	江中药业	2018-05-02	重大事项	17.75	2018-8-1	16.12	23,635	478,317.89	419,521.25	-
000669	金鸿控股	2018-05-18	重大事项	7.25	2018-8-6	6.53	27,952	318,031.57	202,652.00	-
000587	金洲慈航	2018-06-15	重大事项	4.96	2018-7-2	4.46	51,764	391,998.69	256,749.44	-
000939	凯迪生态	2017-11-16	重大事项	4.05	2018-7-2	4.74	93,144	483,901.77	377,233.20	-
002699	美盛文化	2018-02-05	重大事项	15.73	2018-7-2	16.88	19,560	355,158.29	307,678.80	-
002408	齐翔腾达	2018-06-19	重大事项	12.28	-	-	51,781	541,003.74	635,870.68	-
002573	清新环境	2018-06-19	重大事项	11.55	-	-	37,752	701,276.95	436,035.60	-
600022	山东钢铁	2018-03-27	重大事项	1.92	2018-8-16	1.83	365,750	780,208.52	702,240.00	-
600848	上海临港	2018-06-15	重大事项	21.67	-	-	17,800	399,055.06	385,726.00	-
002426	胜利精密	2018-06-19	重大事项	3.60	2018-7-3	3.26	127,400	465,637.00	458,640.00	-
002665	首航节能	2018-5-29	重大事项	5.80	-	-	110,205	772,665.54	639,189.00	-
000825	太钢不锈	2018-04-16	重大事项	5.49	-	-	131,000	626,627.96	719,190.00	-
300146	汤臣倍健	2018-01-31	重大事项	15.38	2018-7-31	16.50	52,600	665,940.08	808,988.00	-
600751	天海投资	2018-01-12	重大事项	6.49	-	-	93,800	718,666.19	608,762.00	-
300197	铁汉生态	2018-05-28	重大事项	5.37	-	-	80,700	650,213.50	433,359.00	-
002147	新光圆成	2018-01-18	重大事项	10.29	-	-	38,290	481,102.25	394,004.10	-
000426	兴业矿业	2018-06-19	重大事项	7.21	-	-	32,640	319,597.90	235,334.40	-
300266	兴源环境	2018-02-05	重大事项	19.99	2018-7-2	17.99	44,800	1,192,582.28	895,552.00	-
300324	旋极	2018-05-30	重大	9.49	-	-	48,922	565,644.97	464,269.78	-

	信息		事项							
002437	誉衡药业	2018-06-11	重大事项	6.20	2018-8-13	5.57	47,555	369,577.71	294,841.00	-
002051	中工国际	2018-04-09	重大事项	12.79	-	-	33,032	592,260.37	422,479.28	-
600158	中体产业	2018-03-27	重大事项	11.64	2018-7-16	11.61	39,771	585,537.58	462,934.44	-
600759	洲际油气	2018-03-27	重大事项	3.94	-	-	66,100	301,221.01	260,434.00	-
002431	棕榈股份	2018-05-30	重大事项	6.71	-	-	61,380	599,161.47	411,859.80	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注:无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内,力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关,并保持跟踪误差在合同约定的范围内。本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设,建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会,主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项;督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查,组织、指导基金管理人内部监察稽核工作,并可向董事会和中国证监会直接报告;在公司内部设立独立的监察稽核部,专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查,并适时提出整改建议。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金

资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在承受的范围之内。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2017 年 12 月 31 日：未持有）。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：无。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

注：无。

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注:无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析,包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金及部分应收申购款，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	23,080,621.15	-	-	-	23,080,621.15



结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	73,389.17	-	-	-	73,389.17
交易性金融资产	-	-	-	-233,603,770.92	233,603,770.92
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	4,543.38	4,543.38
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	370,746.78	370,746.78
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	23,154,010.32	-	-	-233,979,061.08	257,133,071.40
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	149,748.09	149,748.09
应付管理人报酬	-	-	-	154,201.96	154,201.96
应付托管费	-	-	-	30,840.42	30,840.42
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	63,208.59	63,208.59
应付利息	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	253,723.53	253,723.53
负债总计	-	-	-	651,722.59	651,722.59
利率敏感度缺口	23,154,010.32	-	-	-233,327,338.49	256,481,348.81
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	19,409,610.76	-	-	-	19,409,610.76
结算备付金	235,763.38	-	-	-	235,763.38
存出保证金	62,423.95	-	-	-	62,423.95
交易性金融资产	-	-	-	-304,203,692.35	304,203,692.35
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	4,285.96	4,285.96
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	285,155.71	285,155.71
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	19,707,798.09	-	-	-304,493,134.02	324,200,932.11
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	88,780.44	88,780.44
应付管理人报酬	-	-	-	186,591.07	186,591.07
应付托管费	-	-	-	37,318.23	37,318.23
应付证券清算款	-	-	-	2,225,809.59	2,225,809.59

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	197,685.05	197,685.05
应付利息	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	660,117.46	660,117.46
负债总计	-	-	-	3,396,301.84	3,396,301.84
利率敏感度缺口	19,707,798.09	-	-	-301,096,832.18	320,804,630.27

注:表中所示为本基金资产及负债的账面价值,并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注:于 2018 年 6 月 30 日,本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%。

(2017 年 12 月 31 日:未持有),因此当利率发生合理、可能的变动时,对于本基金资产净值无重大影响(2017 年 12 月 31 日:同)

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股,所面临的其他价格风险来源于标的指数成份股和备选成份股证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金为被动式指数基金,原则上采用完全复制的方法,按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化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。同时,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、新股增发等变化,对基金投资组合进行相应调整,以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股,其投资比例不低于基金资产净值的 90%。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风

险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	233,603,770.92	91.08	304,203,692.35	94.83
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	233,603,770.92	91.08	304,203,692.35	94.83

注：无。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年6月 30日）	上年度末（2017年12 月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	12,193,537.42	15,951,084.04
	业绩比较基准下降 5%	-12,193,537.42	-15,951,084.04

注：无。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	233,603,770.92	90.85
	其中：股票	233,603,770.92	90.85
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	23,080,621.15	8.98
8	其他各项资产	448,679.33	0.17
9	合计	257,133,071.40	100.00

### 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	2,339,692.32	0.91
B	采矿业	6,404,538.67	2.50
C	制造业	141,848,947.73	55.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,316,385.33	2.85
E	建筑业	3,521,680.63	1.37
F	批发和零售业	13,950,948.15	5.44
G	交通运输、仓储和邮政业	8,379,688.64	3.27
H	住宿和餐饮业	1,470,766.00	0.57
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,264,202.33	7.12
J	金融业	3,719,123.00	1.45
K	房地产业	11,947,161.78	4.66
L	租赁和商务服务业	4,364,770.15	1.70
M	科学研究和技术服务业	369,772.74	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	2,006,649.01	0.78
O	居民服务、修理和其他	-	-

	服务业		
P	教育	147,364.00	0.06
Q	卫生和社会工作	498,442.20	0.19
R	文化、体育和娱乐业	4,832,640.01	1.88
S	综合	1,695,983.50	0.66
	合计	233,078,756.19	90.88

### 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

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	191,454.74	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	180,774.00	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.03
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	525,014.73	0.20

### 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所有股票投资明细

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	000661	长春高新	15,464	3,521,152.80	1.37
2	600521	华海药业	56,856	1,517,486.64	0.59
3	600426	华鲁恒升	85,967	1,512,159.53	0.59
4	002410	广联达	53,600	1,486,328.00	0.58
5	603019	中科曙光	31,700	1,454,079.00	0.57
6	603589	口子窖	22,000	1,351,900.00	0.53
7	600298	安琪酵母	37,718	1,345,778.24	0.52
8	600315	上海家化	33,713	1,336,046.19	0.52
9	000830	鲁西化工	78,027	1,332,701.16	0.52
10	002078	太阳纸业	135,294	1,310,998.86	0.51
11	000977	浪潮信息	54,400	1,297,440.00	0.51
12	600673	东阳光科	122,649	1,266,964.17	0.49
13	000039	中集集团	94,400	1,253,632.00	0.49
14	600872	中炬高新	42,578	1,192,184.00	0.46
15	002049	紫光国微	26,800	1,182,416.00	0.46
16	002038	双鹭药业	31,000	1,177,690.00	0.46
17	600600	青岛啤酒	26,400	1,157,112.00	0.45
18	600760	中航沈飞	32,000	1,153,280.00	0.45
19	601233	桐昆股份	66,557	1,146,111.54	0.45
20	600201	生物股份	67,038	1,145,679.42	0.45
21	000418	小天鹅A	16,159	1,120,626.65	0.44
22	000860	顺鑫农业	29,288	1,098,300.00	0.43
23	002179	中航光电	27,900	1,088,100.00	0.42
24	603883	老百姓	12,700	1,056,132.00	0.41
25	600004	白云机场	78,700	1,030,183.00	0.40
26	000703	恒逸石化	69,028	1,027,136.64	0.40
27	600258	首旅酒店	37,400	1,016,158.00	0.40
28	002223	鱼跃医疗	51,805	1,009,679.45	0.39
29	000999	华润三九	35,700	993,531.00	0.39
30	000581	威孚高科	44,900	992,739.00	0.39
31	600256	广汇能源	241,680	988,471.20	0.39
32	600885	宏发股份	32,780	980,777.60	0.38
33	300253	卫宁健康	79,085	979,863.15	0.38
34	600325	华发股份	124,975	966,056.75	0.38
35	002340	格林美	159,415	964,460.75	0.38
36	600062	华润双鹤	39,060	958,923.00	0.37
37	000513	丽珠集团	21,739	955,429.05	0.37

38	000656	金科股份	197,300	947,040.00	0.37
39	600642	申能股份	186,000	933,720.00	0.36
40	002589	瑞康医药	68,210	930,384.40	0.36
41	002384	东山精密	38,556	925,344.00	0.36
42	600584	长电科技	54,341	920,536.54	0.36
43	002129	中环股份	115,500	904,365.00	0.35
44	300266	兴源环境	44,800	895,552.00	0.35
45	002092	中泰化学	91,768	884,643.52	0.34
46	002127	南极电商	93,250	875,617.50	0.34
47	600138	中青旅	43,716	871,259.88	0.34
48	600260	凯乐科技	32,459	871,199.56	0.34
49	600884	杉杉股份	39,346	869,546.60	0.34
50	600079	人福医药	64,100	847,402.00	0.33
51	603369	今世缘	36,800	840,144.00	0.33
52	002110	三钢闽光	52,400	839,972.00	0.33
53	300418	昆仑万维	44,000	830,720.00	0.32
54	000690	宝新能源	118,360	823,785.60	0.32
55	002176	江特电机	84,200	818,424.00	0.32
56	002465	海格通信	100,800	809,424.00	0.32
57	300146	汤臣倍健	52,600	808,988.00	0.32
58	002353	杰瑞股份	49,700	807,625.00	0.31
59	000636	风华高科	50,500	801,940.00	0.31
60	600879	航天电子	113,500	797,905.00	0.31
61	600511	国药股份	29,492	794,809.40	0.31
62	600525	长园集团	75,097	793,775.29	0.31
63	600811	东方集团	181,940	782,342.00	0.31
64	600392	盛和资源	48,022	779,397.06	0.30
65	000681	视觉中国	26,800	769,160.00	0.30
66	600572	康恩贝	107,177	768,459.09	0.30
67	002013	中航机电	101,497	768,332.29	0.30
68	300166	东方国信	51,719	761,820.87	0.30
69	002359	北讯集团	38,900	761,662.00	0.30
70	000028	国药一致	15,257	761,324.30	0.30
71	002019	亿帆医药	43,000	758,950.00	0.30
72	002183	怡亚通	112,800	750,120.00	0.29
73	000596	古井贡酒	8,400	745,752.00	0.29
74	000975	银泰资源	72,400	734,136.00	0.29
75	000960	锡业股份	61,000	732,610.00	0.29
76	600267	海正药业	50,200	729,908.00	0.28
77	600967	内蒙一机	57,100	727,454.00	0.28
78	000729	燕京啤酒	107,000	720,110.00	0.28
79	300315	掌趣科技	172,200	719,796.00	0.28

80	002358	森源电气	47,812	719,570.60	0.28
81	000825	太钢不锈	131,000	719,190.00	0.28
82	002268	卫士通	32,880	717,770.40	0.28
83	000732	泰禾集团	36,900	717,705.00	0.28
84	300383	光环新网	53,300	714,753.00	0.28
85	000488	晨鸣纸业	55,106	711,969.52	0.28
86	601168	西部矿业	113,100	710,268.00	0.28
87	600056	中国医药	38,794	708,766.38	0.28
88	600528	中铁工业	69,300	708,246.00	0.28
89	600380	健康元	59,661	707,579.46	0.28
90	600022	山东钢铁	365,750	702,240.00	0.27
91	002440	闰土股份	59,511	695,683.59	0.27
92	601098	中南传媒	54,900	693,936.00	0.27
93	002506	协鑫集成	148,100	693,108.00	0.27
94	000066	中国长城	97,391	692,450.01	0.27
95	000089	深圳机场	90,500	692,325.00	0.27
96	600270	外运发展	33,022	692,141.12	0.27
97	000566	海南海药	53,354	687,733.06	0.27
98	600282	南钢股份	155,100	685,542.00	0.27
99	600161	天坛生物	34,615	669,800.25	0.26
100	603899	晨光文具	21,100	668,659.00	0.26
101	002407	多氟多	47,300	663,146.00	0.26
102	000887	中鼎股份	45,800	659,978.00	0.26
103	002028	思源电气	39,024	655,212.96	0.26
104	002439	启明星辰	30,600	649,332.00	0.25
105	600718	东软集团	49,500	646,470.00	0.25
106	002371	北方华创	12,975	644,468.25	0.25
107	600388	龙净环保	50,200	641,556.00	0.25
108	002665	首航节能	110,205	639,189.00	0.25
109	000997	新大陆	40,386	636,079.50	0.25
110	002408	齐翔腾达	51,781	635,870.68	0.25
111	603885	吉祥航空	41,100	633,351.00	0.25
112	002399	海普瑞	28,500	630,990.00	0.25
113	600839	四川长虹	220,600	630,916.00	0.25
114	002195	二三四五	147,070	629,459.60	0.25
115	002030	达安基因	40,664	627,038.88	0.24
116	600060	海信电器	46,800	626,652.00	0.24
117	600160	巨化股份	85,080	622,785.60	0.24
118	600729	重庆百货	18,571	611,914.45	0.24
119	600643	爱建集团	64,972	610,736.80	0.24
120	600808	马钢股份	170,100	610,659.00	0.24
121	300088	长信科技	105,100	609,580.00	0.24



122	600751	海航科技	93,800	608,762.00	0.24
123	600348	阳泉煤业	84,600	604,890.00	0.24
124	300058	蓝色光标	105,500	601,350.00	0.23
125	000009	中国宝安	122,700	601,230.00	0.23
126	000930	中粮生化	58,147	598,914.10	0.23
127	600655	豫园股份	62,400	589,680.00	0.23
128	600166	福田汽车	289,400	587,482.00	0.23
129	002563	森马服饰	41,000	586,300.00	0.23
130	002690	美亚光电	23,800	567,392.00	0.22
131	002640	跨境通	37,600	564,752.00	0.22
132	000813	德展健康	68,500	564,440.00	0.22
133	600755	厦门国贸	77,113	562,153.77	0.22
134	000848	承德露露	52,986	561,121.74	0.22
135	300182	捷成股份	73,400	556,372.00	0.22
136	600895	张江高科	48,300	555,450.00	0.22
137	600183	生益科技	60,400	553,264.00	0.22
138	600094	大名城	95,900	552,384.00	0.22
139	603816	顾家家居	7,500	551,325.00	0.21
140	002174	游族网络	27,700	551,230.00	0.21
141	600409	三友化工	63,902	550,196.22	0.21
142	000553	沙隆达 A	34,800	550,188.00	0.21
143	300274	阳光电源	61,240	549,322.80	0.21
144	600575	皖江物流	147,900	548,709.00	0.21
145	600460	士兰微	44,969	548,621.80	0.21
146	600737	中粮糖业	72,500	546,650.00	0.21
147	600466	蓝光发展	88,060	545,972.00	0.21
148	002299	圣农发展	35,000	542,150.00	0.21
149	600801	华新水泥	36,007	541,185.21	0.21
150	600143	金发科技	102,900	537,138.00	0.21
151	603658	安图生物	6,500	535,990.00	0.21
152	600418	江淮汽车	82,268	535,564.68	0.21
153	002004	华邦健康	104,835	532,561.80	0.21
154	600216	浙江医药	41,700	532,509.00	0.21
155	300133	华策影视	49,900	531,435.00	0.21
156	600266	北京城建	56,500	531,100.00	0.21
157	600787	中储股份	68,234	528,131.16	0.21
158	600875	东方电气	70,700	523,887.00	0.20
159	600329	中新药业	27,462	521,778.00	0.20
160	002491	通鼎互联	47,100	521,397.00	0.20
161	600648	外高桥	28,400	519,152.00	0.20
162	600291	西水股份	38,800	518,368.00	0.20
163	600499	科达洁能	75,200	515,872.00	0.20

164	600827	百联股份	50,100	511,020.00	0.20
165	600859	王府井	23,849	507,268.23	0.20
166	000401	冀东水泥	57,100	506,477.00	0.20
167	601678	滨化股份	81,840	505,771.20	0.20
168	002273	水晶光电	39,180	504,246.60	0.20
169	002368	太极股份	17,341	504,102.87	0.20
170	600240	华业资本	68,654	503,233.82	0.20
171	002670	国盛金控	46,520	501,020.40	0.20
172	000778	新兴铸管	116,800	499,904.00	0.19
173	300244	迪安诊断	26,220	498,442.20	0.19
174	000988	华工科技	34,350	496,357.50	0.19
175	002221	东华能源	50,418	492,583.86	0.19
176	600086	东方金钰	48,722	489,168.88	0.19
177	002244	滨江集团	93,892	488,238.40	0.19
178	601016	节能风电	169,600	486,752.00	0.19
179	600649	城投控股	79,000	483,480.00	0.19
180	000878	云南铜业	50,600	482,724.00	0.19
181	600563	法拉电子	9,723	481,191.27	0.19
182	600557	康缘药业	38,790	479,056.50	0.19
183	601872	招商轮船	132,300	477,603.00	0.19
184	600125	铁龙物流	56,963	476,780.31	0.19
185	000078	海王生物	98,477	473,674.37	0.18
186	000547	航天发展	60,500	472,505.00	0.18
187	601966	玲珑轮胎	29,900	471,523.00	0.18
188	600835	上海机电	24,846	468,595.56	0.18
189	300055	万邦达	40,700	467,643.00	0.18
190	002073	软控股份	81,314	467,555.50	0.18
191	300324	旋极信息	48,922	464,269.78	0.18
192	600978	宜华生活	67,854	463,442.82	0.18
193	600158	中体产业	39,771	462,934.44	0.18
194	300257	开山股份	30,100	460,229.00	0.18
195	002831	裕同科技	9,200	460,000.00	0.18
196	002426	胜利精密	127,400	458,640.00	0.18
197	600598	北大荒	50,000	458,000.00	0.18
198	300010	立思辰	37,400	457,776.00	0.18
199	000970	中科三环	48,900	457,215.00	0.18
200	002583	海能达	54,500	455,075.00	0.18
201	600754	锦江股份	12,300	454,608.00	0.18
202	600410	华胜天成	51,934	454,422.50	0.18
203	600536	中国软件	20,775	449,363.25	0.18
204	002180	纳思达	16,200	444,852.00	0.17
205	600500	中化国际	64,600	440,572.00	0.17

206	600179	安通控股	43,460	440,249.80	0.17
207	002600	领益智造	84,700	439,593.00	0.17
208	601179	中国西电	128,000	437,760.00	0.17
209	002573	清新环境	37,752	436,035.60	0.17
210	000598	兴蓉环境	107,000	434,420.00	0.17
211	002444	巨星科技	39,395	433,738.95	0.17
212	300197	铁汉生态	80,700	433,359.00	0.17
213	300308	中际旭创	7,200	432,288.00	0.17
214	601000	唐山港	183,598	431,455.30	0.17
215	002603	以岭药业	30,800	430,584.00	0.17
216	600635	大众公用	115,487	429,611.64	0.17
217	002281	光迅科技	20,160	427,392.00	0.17
218	002332	仙琚制药	48,627	425,486.25	0.17
219	600623	华谊集团	42,600	425,148.00	0.17
220	002152	广电运通	72,200	424,536.00	0.17
221	002366	台海核电	29,700	423,522.00	0.17
222	000031	中粮地产	73,183	422,997.74	0.16
223	002051	中工国际	33,032	422,479.28	0.16
224	600970	中材国际	63,150	421,842.00	0.16
225	002373	千方科技	32,314	421,697.70	0.16
226	000685	中山公用	52,774	420,608.78	0.16
227	600614	鹏起科技	73,588	420,187.48	0.16
228	300287	飞利信	58,400	419,896.00	0.16
229	002745	木林森	23,600	419,844.00	0.16
230	600750	江中药业	23,635	419,521.25	0.16
231	600694	大商股份	12,900	419,379.00	0.16
232	600435	北方导航	51,072	416,747.52	0.16
233	300199	翰宇药业	29,100	415,548.00	0.16
234	002191	劲嘉股份	55,524	414,764.28	0.16
235	600993	马应龙	24,324	413,751.24	0.16
236	002431	棕榈股份	61,380	411,859.80	0.16
237	002672	东江环保	31,437	411,510.33	0.16
238	000400	许继电气	52,500	410,025.00	0.16
239	000027	深圳能源	82,900	409,526.00	0.16
240	300026	红日药业	112,000	408,800.00	0.16
241	300113	顺网科技	23,461	408,456.01	0.16
242	600021	上海电力	60,100	405,074.00	0.16
243	002709	天赐材料	10,500	404,670.00	0.16
244	002233	塔牌集团	35,352	404,426.88	0.16
245	603077	和邦生物	233,580	404,093.40	0.16
246	300115	长盈精密	31,085	403,172.45	0.16
247	002251	步步高	35,399	402,840.62	0.16

248	000006	深振业 A	68,707	402,623.02	0.16
249	002131	利欧股份	191,340	401,814.00	0.16
250	600594	益佰制药	44,700	400,512.00	0.16
251	000156	华数传媒	41,400	399,096.00	0.16
252	002701	奥瑞金	72,953	398,323.38	0.16
253	603515	欧普照明	8,500	397,290.00	0.15
254	002242	九阳股份	22,441	396,981.29	0.15
255	002147	新光圆成	38,290	394,004.10	0.15
256	600863	内蒙华电	173,200	393,164.00	0.15
257	600717	天津港	52,100	392,313.00	0.15
258	002285	世联行	61,700	386,859.00	0.15
259	600098	广州发展	59,900	386,355.00	0.15
260	600848	上海临港	17,800	385,726.00	0.15
261	002390	信邦制药	52,687	385,668.84	0.15
262	600280	中央商场	43,832	382,215.04	0.15
263	000738	航发控制	28,500	379,905.00	0.15
264	600064	南京高科	51,622	378,905.48	0.15
265	601717	郑煤机	65,205	378,841.05	0.15
266	600823	世茂股份	90,300	377,454.00	0.15
267	000939	凯迪生态	93,144	377,233.20	0.15
268	600503	华丽家族	96,300	376,533.00	0.15
269	600664	哈药股份	94,760	376,197.20	0.15
270	600307	酒钢宏兴	178,800	375,480.00	0.15
271	600597	光明乳业	38,000	375,060.00	0.15
272	002249	大洋电机	86,750	373,892.50	0.15
273	601880	大连港	192,022	372,522.68	0.15
274	600645	中源协和	19,199	369,772.74	0.14
275	600122	宏图高科	49,882	369,126.80	0.14
276	600120	浙江东方	27,153	367,923.15	0.14
277	600017	日照港	114,507	367,567.47	0.14
278	002276	万马股份	62,401	364,421.84	0.14
279	600881	亚泰集团	97,668	364,301.64	0.14
280	002280	联络互动	63,500	363,220.00	0.14
281	600580	卧龙电气	47,286	360,319.32	0.14
282	600026	中远海能	84,756	359,365.44	0.14
283	002056	横店东磁	50,908	356,865.08	0.14
284	600171	上海贝岭	30,762	356,223.96	0.14
285	603766	隆鑫通用	65,518	355,762.74	0.14
286	600039	四川路桥	108,450	355,716.00	0.14
287	002005	德豪润达	81,330	354,598.80	0.14
288	002266	浙富控股	94,440	354,150.00	0.14
289	000766	通化金马	29,700	352,836.00	0.14

290	002477	雏鹰农牧	104,812	346,927.72	0.14
291	600037	歌华有线	33,400	344,688.00	0.13
292	002839	张家港行	56,400	343,476.00	0.13
293	600582	天地科技	93,445	342,943.15	0.13
294	000807	云铝股份	65,900	341,362.00	0.13
295	002212	南洋股份	28,600	340,054.00	0.13
296	600869	智慧能源	71,854	339,150.88	0.13
297	002128	露天煤业	37,300	337,938.00	0.13
298	300001	特锐德	29,700	337,392.00	0.13
299	002505	大康农业	156,970	335,915.80	0.13
300	000718	苏宁环球	91,200	334,704.00	0.13
301	601200	上海环境	21,000	332,430.00	0.13
302	000501	鄂武商 A	26,985	331,645.65	0.13
303	002916	深南电路	5,200	330,252.00	0.13
304	000926	福星股份	45,825	329,481.75	0.13
305	000012	南玻 A	66,489	329,120.55	0.13
306	300159	新研股份	46,400	328,512.00	0.13
307	000667	美好置业	154,191	328,426.83	0.13
308	300002	神州泰岳	78,200	326,094.00	0.13
309	600908	无锡银行	55,100	324,539.00	0.13
310	000758	中色股份	71,900	323,550.00	0.13
311	002400	省广集团	99,446	321,210.58	0.13
312	600936	广西广电	66,900	318,444.00	0.12
313	000563	陕国投 A	91,832	312,228.80	0.12
314	300273	和佳股份	45,470	308,286.60	0.12
315	002699	美盛文化	19,560	307,678.80	0.12
316	002250	联化科技	34,849	307,368.18	0.12
317	600169	太原重工	130,900	306,306.00	0.12
318	600195	中牧股份	15,734	306,026.30	0.12
319	600611	大众交通	76,587	304,816.26	0.12
320	600141	兴发集团	26,118	304,274.70	0.12
321	002022	科华生物	25,454	301,629.90	0.12
322	601311	骆驼股份	26,254	301,133.38	0.12
323	002517	恺英网络	41,800	300,542.00	0.12
324	002424	贵州百灵	26,400	299,904.00	0.12
325	002155	湖南黄金	43,800	299,592.00	0.12
326	600478	科力远	58,648	299,104.80	0.12
327	300376	易事特	55,600	298,572.00	0.12
328	600151	航天机电	73,400	298,004.00	0.12
329	000806	银河生物	68,700	297,471.00	0.12
330	002807	江阴银行	52,800	296,736.00	0.12
331	002512	达华智能	30,500	295,850.00	0.12

332	002635	安洁科技	17,153	295,031.60	0.12
333	002437	誉衡药业	47,555	294,841.00	0.11
334	002434	万里扬	33,300	292,374.00	0.11
335	000727	华东科技	155,400	292,152.00	0.11
336	002002	鸿达兴业	63,338	291,988.18	0.11
337	002254	泰和新材	25,544	290,690.72	0.11
338	002544	杰赛科技	21,200	290,228.00	0.11
339	002048	宁波华翔	23,372	288,176.76	0.11
340	002064	华峰氨纶	69,722	287,951.86	0.11
341	600277	亿利洁能	54,900	287,676.00	0.11
342	000021	深科技	42,056	286,821.92	0.11
343	002345	潮宏基	33,134	284,952.40	0.11
344	600416	湘电股份	39,521	284,155.99	0.11
345	002277	友阿股份	61,582	283,893.02	0.11
346	601801	皖新传媒	37,200	283,092.00	0.11
347	000543	皖能电力	64,051	282,464.91	0.11
348	601608	中信重工	108,400	281,840.00	0.11
349	002317	众生药业	26,602	281,183.14	0.11
350	600777	新潮能源	125,900	275,721.00	0.11
351	603198	迎驾贡酒	15,000	275,550.00	0.11
352	600317	营口港	120,700	272,782.00	0.11
353	600545	卓郎智能	34,342	272,675.48	0.11
354	300297	蓝盾股份	33,600	272,496.00	0.11
355	002509	天广中茂	93,400	271,794.00	0.11
356	002463	沪电股份	72,619	271,595.06	0.11
357	600073	上海梅林	40,876	271,416.64	0.11
358	000090	天健集团	43,325	268,615.00	0.10
359	002118	紫鑫药业	37,396	267,381.40	0.10
360	300039	上海凯宝	46,079	267,258.20	0.10
361	000712	锦龙股份	26,600	265,468.00	0.10
362	000612	焦作万方	50,562	265,450.50	0.10
363	600259	广晟有色	9,031	264,427.68	0.10
364	601689	拓普集团	13,600	264,384.00	0.10
365	600335	国机汽车	25,308	263,962.44	0.10
366	600422	昆药集团	34,014	263,608.50	0.10
367	600770	综艺股份	44,675	263,582.50	0.10
368	600773	西藏城投	38,065	263,409.80	0.10
369	601928	凤凰传媒	43,300	263,264.00	0.10
370	300134	大富科技	29,430	263,104.20	0.10
371	600458	时代新材	35,690	262,678.40	0.10
372	603000	人民网	31,500	261,450.00	0.10
373	000158	常山北明	37,960	260,785.20	0.10

374	000062	深圳华强	13,300	260,680.00	0.10
375	600759	洲际油气	66,100	260,434.00	0.10
376	002308	威创股份	31,259	259,449.70	0.10
377	600565	迪马股份	87,500	258,125.00	0.10
378	002011	盾安环境	40,205	257,312.00	0.10
379	002707	众信旅游	26,800	257,280.00	0.10
380	600108	亚盛集团	88,900	256,921.00	0.10
381	000587	金洲慈航	51,764	256,749.44	0.10
382	000519	中兵红箭	32,908	255,695.16	0.10
383	603659	璞泰来	4,000	255,560.00	0.10
384	000877	天山股份	37,848	255,474.00	0.10
385	600633	浙数文化	30,600	255,204.00	0.10
386	002354	天神娱乐	27,520	254,835.20	0.10
387	002302	西部建设	23,600	254,172.00	0.10
388	600366	宁波韵升	41,624	253,906.40	0.10
389	002375	亚厦股份	47,500	253,650.00	0.10
390	300156	神雾环保	37,800	252,126.00	0.10
391	600578	京能电力	80,500	251,160.00	0.10
392	000592	平潭发展	88,200	250,488.00	0.10
393	000937	冀中能源	60,800	249,888.00	0.10
394	001696	宗申动力	50,645	248,160.50	0.10
395	000528	柳工	22,900	245,259.00	0.10
396	002489	浙江永强	67,329	245,077.56	0.10
397	000572	海马汽车	71,401	244,905.43	0.10
398	600874	创业环保	25,945	242,326.30	0.09
399	000829	天音控股	32,897	241,135.01	0.09
400	002428	云南锗业	31,178	240,694.16	0.09
401	000762	西藏矿业	24,790	238,727.70	0.09
402	000600	建投能源	42,800	238,396.00	0.09
403	600300	维维股份	72,622	236,747.72	0.09
404	600687	刚泰控股	26,000	236,340.00	0.09
405	002093	国脉科技	30,550	235,540.50	0.09
406	000426	兴业矿业	32,640	235,334.40	0.09
407	600312	平高电气	41,512	234,127.68	0.09
408	000049	德赛电池	8,208	231,629.76	0.09
409	600155	宝硕股份	32,200	231,518.00	0.09
410	000541	佛山照明	38,547	230,896.53	0.09
411	600316	洪都航空	24,600	229,272.00	0.09
412	600395	盘江股份	37,700	228,839.00	0.09
413	000969	安泰科技	36,574	228,587.50	0.09
414	600393	粤泰股份	62,800	227,336.00	0.09
415	600187	国中水务	79,600	226,064.00	0.09

416	603188	亚邦股份	22,000	224,400.00	0.09
417	002482	广田集团	37,037	221,110.89	0.09
418	603556	海兴电力	12,160	220,947.20	0.09
419	002681	奋达科技	25,368	219,686.88	0.09
420	000990	诚志股份	15,600	218,400.00	0.09
421	002657	中科金财	13,700	217,008.00	0.08
422	002841	视源股份	4,020	214,708.20	0.08
423	000552	靖远煤电	65,018	212,608.86	0.08
424	002503	搜于特	60,720	212,520.00	0.08
425	601777	力帆股份	40,428	211,438.44	0.08
426	000061	农产品	38,700	208,980.00	0.08
427	603568	伟明环保	8,150	206,195.00	0.08
428	600765	中航重机	27,395	203,818.80	0.08
429	002920	德赛西威	6,800	203,320.00	0.08
430	300116	坚瑞沃能	73,600	203,136.00	0.08
431	600971	恒源煤电	28,422	202,933.08	0.08
432	600058	五矿发展	24,400	202,764.00	0.08
433	000669	金鸿控股	27,952	202,652.00	0.08
434	600006	东风汽车	49,443	202,221.87	0.08
435	002642	荣之联	22,000	202,180.00	0.08
436	300202	聚龙股份	19,222	200,485.46	0.08
437	600880	博瑞传播	46,800	199,368.00	0.08
438	600757	长江传媒	34,444	195,986.36	0.08
439	600657	信达地产	45,834	194,794.50	0.08
440	601127	小康股份	11,200	193,648.00	0.08
441	002663	普邦股份	65,078	193,281.66	0.08
442	600639	浦东金桥	15,211	189,833.28	0.07
443	002261	拓维信息	41,200	189,520.00	0.07
444	600428	中远海特	53,322	189,293.10	0.07
445	002588	史丹利	35,820	185,547.60	0.07
446	603328	依顿电子	16,908	183,451.80	0.07
447	002342	巨力索具	47,788	181,116.52	0.07
448	603444	吉比特	1,400	178,906.00	0.07
449	600481	双良节能	58,376	178,630.56	0.07
450	002190	成飞集成	10,300	176,027.00	0.07
451	600350	山东高速	42,000	170,100.00	0.07
452	600748	上实发展	33,312	167,892.48	0.07
453	600338	西藏珠峰	8,100	167,832.00	0.07
454	300291	华录百纳	23,117	162,974.85	0.06
455	600651	飞乐音响	41,391	161,424.90	0.06
456	002479	富春环保	28,306	159,928.90	0.06
457	002344	海宁皮城	32,800	159,408.00	0.06



458	600640	号百控股	15,587	158,519.79	0.06
459	603888	新华网	9,300	156,798.00	0.06
460	300043	星辉娱乐	38,459	153,836.00	0.06
461	002414	高德红外	11,250	151,200.00	0.06
462	600517	置信电气	40,532	149,968.40	0.06
463	002041	登海种业	21,890	149,289.80	0.06
464	603228	景旺电子	3,000	148,320.00	0.06
465	603377	东方时尚	10,640	147,364.00	0.06
466	600743	华远地产	56,727	145,788.39	0.06
467	600862	中航高科	23,700	145,755.00	0.06
468	603355	莱克电气	4,800	144,240.00	0.06
469	600167	联美控股	14,300	143,000.00	0.06
470	600184	光电股份	11,540	142,980.60	0.06
471	603806	福斯特	6,210	136,682.10	0.05
472	600292	远达环保	23,243	136,436.41	0.05
473	002416	爱施德	23,220	136,301.40	0.05
474	603868	飞科电器	2,800	135,436.00	0.05
475	601019	山东出版	16,900	135,369.00	0.05
476	603225	新风鸣	6,680	133,399.60	0.05
477	600053	九鼎投资	7,700	132,209.00	0.05
478	600126	杭钢股份	22,100	131,937.00	0.05
479	600996	贵广网络	17,700	131,334.00	0.05
480	601001	大同煤业	26,200	129,952.00	0.05
481	601020	华钰矿业	9,400	129,626.00	0.05
482	000987	越秀金控	15,900	124,974.00	0.05
483	603877	太平鸟	3,600	119,988.00	0.05
484	600618	氯碱化工	14,098	119,973.98	0.05
485	601128	常熟银行	20,900	119,548.00	0.05
486	603169	兰石重装	23,200	116,232.00	0.05
487	300032	金龙机电	20,400	114,444.00	0.04
488	002815	崇达技术	6,900	111,090.00	0.04
489	000025	特力A	3,400	109,378.00	0.04
490	000536	华映科技	37,900	104,225.00	0.04
491	002818	富森美	3,300	87,054.00	0.03
492	000761	本钢板材	20,500	82,820.00	0.03
493	601811	新华文轩	8,200	79,704.00	0.03
494	603025	大豪科技	3,880	75,039.20	0.03
495	601969	海南矿业	13,600	74,528.00	0.03
496	603569	长久物流	5,180	73,970.40	0.03
497	600939	重庆建工	14,600	72,124.00	0.03
498	000686	东北证券	11,000	70,510.00	0.03
499	600917	重庆燃气	10,300	70,143.00	0.03

500	000979	中弘股份	51,400	51,914.00	0.02
501	000980	众泰汽车	4,700	33,417.00	0.01
502	000693	*ST 华泽	19,205	10,562.75	0.00

### 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

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	603056	德邦股份	6,600	180,774.00	0.07
2	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.05
3	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.03
4	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.02
5	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.02
6	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.01
7	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.01

## 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	600176	中国巨石	1,645,879.00	0.51
2	600516	方大炭素	1,623,862.00	0.51
3	000661	长春高新	1,610,505.00	0.50
4	600438	通威股份	1,465,509.00	0.46
5	603589	口子窖	1,165,590.00	0.36
6	600760	中航沈飞	1,138,112.00	0.35
7	002179	中航光电	1,111,337.00	0.35
8	600346	恒力股份	1,102,830.00	0.34
9	002049	紫光国微	1,101,618.00	0.34
10	600258	首旅酒店	1,019,388.00	0.32
11	000039	中集集团	997,882.00	0.31
12	002050	三花智控	986,131.00	0.31
13	600004	白云机场	950,888.00	0.30
14	002110	三钢闽光	937,102.00	0.29
15	002129	中环股份	931,886.00	0.29
16	600600	青岛啤酒	889,800.00	0.28
17	300418	昆仑万维	881,700.00	0.27
18	600460	士兰微	876,904.00	0.27
19	600282	南钢股份	854,881.00	0.27
20	600885	宏发股份	846,815.00	0.26

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	002001	新 和 成	3,071,573.63	0.96
2	002405	四维图新	2,581,902.52	0.80
3	002422	科伦药业	2,410,732.00	0.75
4	600516	方大炭素	2,355,648.00	0.73
5	000786	北新建材	2,243,372.88	0.70
6	002050	三花智控	2,110,280.87	0.66
7	600176	中国巨石	2,062,270.88	0.64
8	002271	东方雨虹	2,007,050.12	0.63
9	000998	隆平高科	1,523,456.82	0.47
10	002049	紫光国微	1,431,790.00	0.45
11	002195	二三四五	1,419,143.30	0.44
12	000050	深天马 A	1,279,523.31	0.40
13	600346	恒力股份	1,238,077.00	0.39
14	600566	济川药业	1,214,836.00	0.38
15	002311	海大集团	1,187,130.20	0.37
16	600879	航天电子	1,135,771.12	0.35
17	601699	潞安环能	1,118,214.00	0.35
18	002179	中航光电	1,089,992.68	0.34
19	603589	口子窖	1,058,998.00	0.33
20	000661	长春高新	1,017,793.00	0.32

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	119,448,371.50
卖出股票收入(成交)总额	149,222,491.66

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:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

### 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	73,389.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,543.38
5	应收申购款	370,746.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	448,679.33

#### 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

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 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	603693	江苏新能	48,456.00	0.02	新股锁定

#### 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

### 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 (%)
12,038	18,759.61	38,746,304.08	17.16	187,081,932.13	82.84

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
----	-------	----------	--------------

1	黄月明	277,000.00	3.89
2	高炜	220,300.00	3.09
3	深圳市博凯保健品有限公司	200,028.00	2.81
4	张宏旭	200,012.00	2.81
5	施红梅	197,014.00	2.77
6	卢翠馨	195,030.00	2.74
7	陈吉荃	150,042.00	2.11
8	罗丽珊	148,425.00	2.09
9	鹿敏理	119,003.00	1.67
10	俞富良	117,026.00	1.64

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	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	108,807.90	0.0482

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、基金投资和研发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

单位:份

基金合同生效日 (2010 年 2 月 5 日) 基金份额总额	2,630,723,634.12
本报告期期初基金份额总额	239,490,327.51
本报告期基金总申购份额	65,849,749.60
减:本报告期基金总赎回份额	79,511,840.90
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	225,828,236.21

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

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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。

基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动：基金托管人的专门基金托管部门本报告期内无重大人事变动。

### 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

本基金本报告期基金投资策略未改变。

### 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

#### 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	
长江证券	1	90,810,945.69	34.11%	82,756.60	33.77%	-
银河证券	1	70,093,548.45	26.33%	65,276.05	26.64%	-
国信证券	2	67,216,050.54	25.25%	62,304.80	25.42%	-
广发证券	1	38,102,801.65	14.31%	34,722.96	14.17%	-

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。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国国际金融股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 01 月 12 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 01 月 17 日
3	2017 年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 01 月 22 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与湘财证券股份有限公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 01 月 24 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 01 月 24 日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海华信证券有限责任公司开	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 01 月 30 日



	展基金转换费率优惠活动的公告		
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 02 月 02 日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 02 月 03 日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 02 月 06 日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 02 月 07 日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 02 月 08 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 02 月 10 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 03 月 02 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 03 月 10 日
15	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 更新的招募说明书摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 03 月 17 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 03 月 21 日
17	关于鹏华旗下 139 只基金修改基金合同的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 03 月 23 日
18	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 03 月 24 日
19	2017 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 03 月 29 日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东莞农村商业银行股份有限公司手机银行基金认/申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 03 月 31 日
21	鹏华基金管理有限公司关于增加上海万得投资顾问有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 04 月 04 日

22	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信建投证券股份有限公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 04 月 09 日
23	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东海证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 04 月 09 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 04 月 11 日
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 04 月 14 日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 04 月 18 日
27	2018 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 04 月 21 日
28	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 04 月 24 日
29	鹏华基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 04 月 27 日
30	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低转换份额和账户最低余额限制的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 05 月 09 日
31	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 05 月 09 日
32	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银河证券股份有限公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 05 月 21 日
33	鹏华基金管理有限公司关于提请投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 05 月 28 日
34	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 05 月 29 日
35	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 05 月 31 日
36	鹏华基金管理有限公司关于提请非自	《中国证券报》、《上海	2018 年 06 月 01 日

	然人客户及时登记受益所有人信息的公告	证券报》、《证券时报》	
37	鹏华基金关于调整旗下部分基金单笔最低定投金额限制的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 06 月 08 日
38	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 06 月 12 日
39	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 06 月 15 日
40	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 06 月 16 日
41	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 06 月 20 日
42	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 06 月 22 日
43	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 06 月 22 日
44	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 06 月 27 日
45	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 06 月 28 日
46	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 06 月 29 日
47	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 06 月 30 日
48	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司网上银行渠道基金定投手续费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2018 年 06 月 30 日

注:无。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》;
- (二)《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》;
- (三)《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2018 年半年度报告》(原文)。

### 12.2 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

北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行股份有限公司

### 12.3 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

2018 年 08 月 27 日