

鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)2019 年半年度报告

2019 年 6 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：2019 年 8 月 23 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 2019 年 8 月 22 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 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	36
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	52
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	52
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
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末上市基金前十名持有人	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 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	
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	284,070,311.62 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	
下属分级基金的基 金简称	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	鹏华 500 指数 C 类 (LOF)
下属分级基金的交 易代码	160616	006938
报告期末下属分级 基金的份额总额	266,494,863.49 份	17,575,448.13 份

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。

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	郭明
	联系电话	0755-82825720	010-66105799
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105798
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	陈四清

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》
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(2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日)	
	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	鹏华 500 指数 C 类 (LOF)
本期已实现收益	-3,351,231.40	-252,320.07
本期利润	47,592,619.26	-1,059,711.22
加权平均基金份额	0.1781	-0.1162

额本期利润		
本期加权平均净值利润率	16.29%	-9.82%
本期基金份额净值增长率	18.89%	15.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2019 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	23,844,860.24	-90,727.94
期末可供分配基金份额利润	0.0895	-0.0052
期末基金资产净值	290,339,723.73	20,245,067.25
期末基金份额净值	1.089	1.152
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2019 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	8.90%	15.20%

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。

(4) 自 2019 年 1 月 22 日起鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 增加 C 类基金份额, 故鹏华 500 指数 C 类 (LOF) 的报告期间为 2019 年 1 月 22 日-2019 年 6 月 30 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

鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)

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	0.74%	1.30%	0.76%	1.32%	-0.02%	-0.02%
过去三个月	-9.63%	1.71%	-10.20%	1.72%	0.57%	-0.01%
过去六个月	18.89%	1.68%	17.88%	1.70%	1.01%	-0.02%
过去一年	-4.14%	1.59%	-4.68%	1.60%	0.54%	-0.01%
过去三年	-10.81%	1.24%	-17.95%	1.25%	7.14%	-0.01%
自基金成立起	8.90%	1.67%	13.86%	1.63%	-4.96%	0.04%

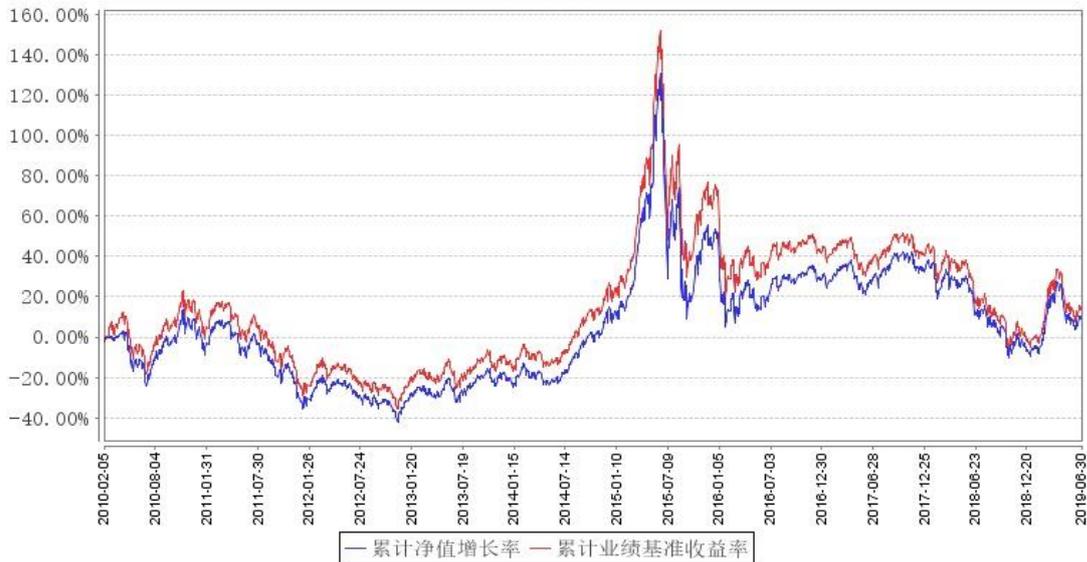
鹏华 500 指数 C 类 (LOF)

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	0.79%	1.30%	0.76%	1.32%	0.03%	-0.02%
过去三个月	-9.58%	1.70%	-10.20%	1.72%	0.62%	-0.02%
自基金成立起	15.20%	1.75%	12.61%	1.78%	2.59%	-0.03%

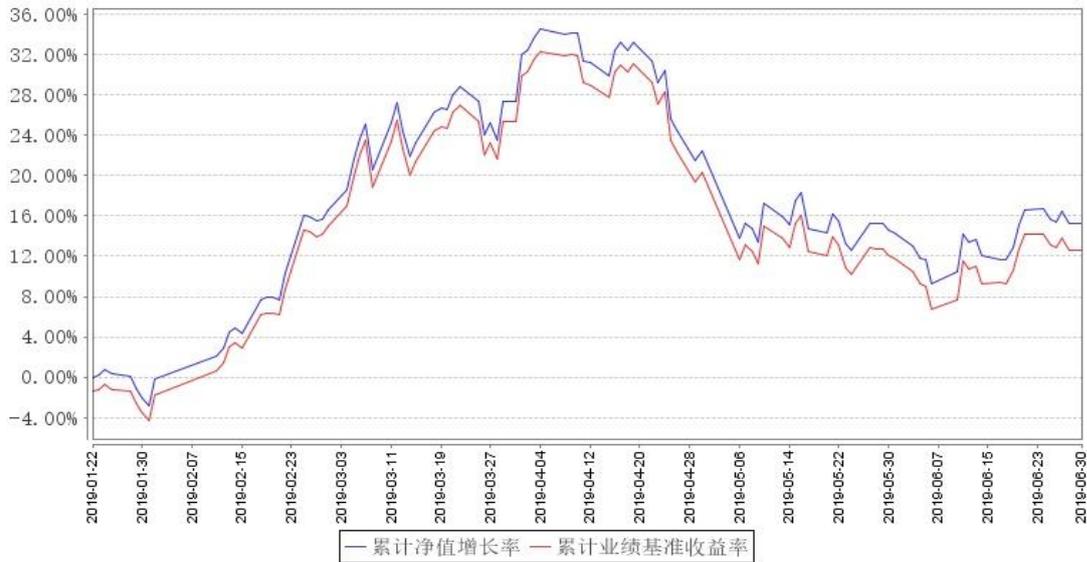
注:业绩比较基准=中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%

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A类 (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



鹏华500指数C类 (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



注:1、本基金基金合同于 2010 年 02 月 05 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。截止到 2019 年 6 月,公司管理资产总规模达到 5,644.95 亿元,管理 159 只公募基金、10 只全国社保投资组合、4 只基本养老保险投资组合。

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	-	12	张羽翔先生,国籍中国,工学硕士,12 年证券基金从业经验。曾任招商银行软

				<p>件中心(原深圳市融博技术公司)数据分析师; 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; 现任量化及衍生品投资部基金经理。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 月担任鹏华一带一路分级基金基金经理, 2016 年 11 月担任鹏华新能源分级基金基金经理, 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 月至 2018 年 08 月担任鹏华沪深 300 指数增强基金基金经理, 2018</p>
--	--	--	--	--

					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 月担任鹏华钢铁分级基金基金经理, 2019 年 04 月担任酒 ETF 基金基金经理, 2019 年 07 月担任国防 ETF 基金基金经理。张羽翔先生具备基金从业资格。本报告期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

本基金本报告期内，鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF) 组合净值增长率 18.89%; 业绩比较基准增长率 17.88%; 鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF) 组合净值增长率 15.20%; 业绩比较基准增长率 12.61%;

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年上半年权益市场受金融去杠杆和贸易战的影响，指数震荡盘整。上半年，积极的财政政策发力，支撑基建投资增速稳定，但财政支出节奏相对较块，下半年的财政支出受空间影响，节奏可能放缓，会对基建资金形成一定影响，地方政府专项债加速发行将在三季度末前发力，预计四季度地方政府又将受到资金方面的压力。地产投资增速可能回落至两位数以下，受销售走低影响，投资保持加速增长的可能性不大。总的来看，固定资产投资增速可能三季度将仍保持稳定。

“国际经济金融形势错综复杂，外部不确定不稳定因素增多”，国际风险因素主要指的是短期内全球经济增长动能偏弱，中美贸易摩擦，各经济体存在脆弱性，地缘政治冲突多点爆发等。国内方面的风险则是出口增速下行，民间投资动能不足，制造业投资上行乏力，综合体现为 2 季度 GDP 增速创 1992 年 1 季度以来新低。“科创板”是定位为支持我国“新经济”公司发展的一个股权市场，是我国产业升级、经济转型之国家战略在资本市场的体现。随着全球技术和产业的变迁，“新经济”公司已经站在了全球企业界的巅峰。“科创板”作为一个变局者，有望成为我国“新经济”公司发展的沃土，在推进我国产业升级的同时，给投资者带来丰厚回报。“科创板”也会改变我国金融格局。

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

中证 500C 份额：

1、截止本报告期末，本基金 C 份额可供分配利润为-90,727.94 元，期末基金份额净值 1.152 元，不符合利润分配条件。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

中证 500A 份额：

1、截止本报告期末，本基金 A 份额可供分配利润为 23,844,860.24 元，期末基金份额净值 1.089 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) 2019 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:2019 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	17,190,143.75	20,971,749.69
结算备付金		178,421.92	233,025.93
存出保证金		38,701.01	37,173.08
交易性金融资产	6.4.7.2	294,906,044.34	232,590,793.15
其中:股票投资		294,906,044.34	232,590,793.15
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		2,057,718.26	-
应收利息	6.4.7.5	3,174.65	4,120.08
应收股利		-	-
应收申购款		463,610.75	619,999.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		314,837,814.68	254,456,861.06
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债:			
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		-	7,495,521.68
应付赎回款		3,488,743.35	106,861.38
应付管理人报酬		189,894.34	160,669.78
应付托管费		37,978.87	32,133.95
应付销售服务费		3,503.49	-
应付交易费用	6.4.7.7	147,705.98	145,481.43
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	385,197.67	400,149.41
负债合计		4,253,023.70	8,340,817.63
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	284,070,311.62	268,637,138.23
未分配利润	6.4.7.10	26,514,479.36	-22,521,094.80
所有者权益合计		310,584,790.98	246,116,043.43
负债和所有者权益总计		314,837,814.68	254,456,861.06

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 284,070,311.62 份，其中鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF) 基金份额总额为 266,494,863.49 份，基金份额净值 1.089 元；鹏华 500 指数 C 类 (LOF) 基金份额总额为 17,575,448.13 份，基金份额净值 1.152 元。

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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		48,482,050.50	-39,062,795.67
1. 利息收入		70,574.12	68,029.20
其中：存款利息收入	6.4.7.11	70,574.12	68,029.20
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）		-2,037,268.76	-3,979,690.06
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,806,638.96	-5,568,580.68

基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	2,769,370.20	1,588,890.62
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.17	50,136,459.51	-35,257,220.59
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	312,285.63	106,085.78
减: 二、费用		1,949,142.46	1,922,695.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,114,094.97	1,000,913.85
2. 托管费	6.4.10.2.2	222,818.96	200,182.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	9,189.59	-
4. 交易费用	6.4.7.19	373,922.46	417,915.31
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	229,116.48	303,683.68
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		46,532,908.04	-40,985,491.36
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		46,532,908.04	-40,985,491.36

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: 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	268,637,138.23	-22,521,094.80	246,116,043.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	46,532,908.04	46,532,908.04
三、本期基金份额交易产生的基	15,433,173.39	2,502,666.12	17,935,839.51

金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)			
其中: 1. 基金申 购款	206,158,579.72	32,589,235.79	238,747,815.51
2. 基金赎 回款	-190,725,406.33	-30,086,569.67	-220,811,976.00
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)	284,070,311.62	26,514,479.36	310,584,790.98
项目	上年度可比期间 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

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:

邓召明

基金管理人负责人

苏波

主管会计工作负责人

郝文高

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。

根据鹏华基金管理有限公司《关于鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 和鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 新增 C 类基金份额并修改基金合同的公告》,本基金根据所收取费用的差异,将基金份额分为不同的类别,自 2019 年 1 月 22 日起增设 C 类基金份额,原有的基金份额转为 A 类基金份额。其中,在投资人申购基金时收取前端申购费用,且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费,且不收取申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。C 类基金份额通过场外方式申购,不在交易所上市交易,亦不开通场内申购赎回方式。除经基金管理人另行公告,C 类基金份额持有人不能进行跨系统转登记。由于基金费用收取方式的不同,A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 2019 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 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。

资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	17,190,143.75
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 个月以上	-
其他存款	-
合计	17,190,143.75

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	313,250,183.74	294,906,044.34	-18,344,139.40
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	313,250,183.74	294,906,044.34	-18,344,139.40

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截止本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

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：截止本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截止本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,086.63
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	72.27
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	15.75
合计	3,174.65

6.4.7.6 其他资产

注:截止本报告期末,本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	147,705.98
银行间市场应付交易费用	-
合计	147,705.98

6.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,405.19
预提费用	328,792.48
应付指数使用费	50,000.00
合计	385,197.67

6.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	268,637,138.23	268,637,138.23
本期申购	169,473,252.70	169,473,252.70
本期赎回(以“-”号填列)	-171,615,527.44	-171,615,527.44
-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	266,494,863.49	266,494,863.49

鹏华 500 指数 C 类 (LOF)

项目	本期 2019年1月22日至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
本期申购	36,685,327.02	36,685,327.02
本期赎回(以“-”号填列)	-19,109,878.89	-19,109,878.89
-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	17,575,448.13	17,575,448.13
-----	---------------	---------------

注:1、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。

2、自 2019 年 1 月 22 日起鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 增加 C 类基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	192,292,950.17	-214,814,044.97	-22,521,094.80
本期利润	-3,351,231.40	50,943,850.66	47,592,619.26
本期基金份额交易产生的变动数	-1,621,502.73	394,838.51	-1,226,664.22
其中:基金申购款	120,489,219.40	-95,715,754.35	24,773,465.05
基金赎回款	-122,110,722.13	96,110,592.86	-26,000,129.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	187,320,216.04	-163,475,355.80	23,844,860.24
鹏华 500 指数 C 类 (LOF)			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-252,320.07	-807,391.15	-1,059,711.22
本期基金份额交易产生的变动数	161,592.13	3,567,738.21	3,729,330.34
其中:基金申购款	267,398.07	7,548,372.67	7,815,770.74
基金赎回款	-105,805.94	-3,980,634.46	-4,086,440.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-90,727.94	2,760,347.06	2,669,619.12

6.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	67,176.58
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	2,356.66
其他	1,040.88

合计	70,574.12
----	-----------

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
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	120,423,169.07
减:卖出股票成本总额	125,229,808.03
买卖股票差价收入	-4,806,638.96

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
	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,769,370.20
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,769,370.20

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	50,136,459.51
股票投资	50,136,459.51
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	50,136,459.51

6.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	281,518.07
基金转换费收入	30,767.56
合计	312,285.63

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	373,922.46
银行间市场交易费用	-
合计	373,922.46

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	74,244.51
银行汇划费用	324.00
指数使用费	100,000.00
上市年费	29,752.78
合计	229,116.48

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（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	151,041,119.70	59.76	67,216,050.54	25.25

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 2019年1月1日至2019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	140,005.90	60.16	96,545.22	65.36
关联方名称	上年度可比期间 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

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	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,114,094.97	1,000,913.85
其中: 支付销售机构的客户维护费	295,883.38	236,433.45

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	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	222,818.96	200,182.85

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

单位: 人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	鹏华 500 指数 C 类(LOF)	合计
鹏华基金公司	-	3,330.03	3,330.03

合计		3,330.03	3,330.03
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	鹏华 500 指数 C 类 (LOF)	合计
-	-	-	-
合计			

注:支付基金销售机构的 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%,逐日计提,按月支付,A 类基金份额不支付销售服务费。日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.20%÷当年天数。

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:本基金本报告期及上年度可比期间没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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自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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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
中国工商银行	17,190,143.75	67,176.58	23,080,621.15	62,371.47

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:本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与本管理人、管理人控股股东、托管人、委托人及委托人控股股东承销的证券。

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(2019 年 6 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
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 07 月 05 日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

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, 将风险控制可在可承受的范围内。

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 2019 年 6 月 30 日, 本基金未持有信用类债券 (2018 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

注：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,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 2019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	17,190,143.75	-	-	-	17,190,143.75
结算备付金	178,421.92	-	-	-	178,421.92
存出保证金	38,701.01	-	-	-	38,701.01
交易性金融资产	-	-	-	294,906,044.34	294,906,044.34
应收利息	-	-	-	3,174.65	3,174.65
应收申购款	-	-	-	463,610.75	463,610.75
应收证券清算款	-	-	-	2,057,718.26	2,057,718.26
资产总计	17,407,266.68	-	-	297,430,548.00	314,837,814.68
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,488,743.35	3,488,743.35
应付管理人报酬	-	-	-	189,894.34	189,894.34

应付托管费	-	-	-	37,978.87	37,978.87
应付销售服务费	-	-	-	3,503.49	3,503.49
应付交易费用	-	-	-	147,705.98	147,705.98
其他负债	-	-	-	385,197.67	385,197.67
负债总计	-	-	-	4,253,023.70	4,253,023.70
利率敏感度缺口	17,407,266.68	-	-	-293,177,524.30	310,584,790.98
上年度末 2018 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	20,971,749.69	-	-	-	20,971,749.69
结算备付金	233,025.93	-	-	-	233,025.93
存出保证金	37,173.08	-	-	-	37,173.08
交易性金融资产	-	-	-	-232,590,793.15	232,590,793.15
应收利息	-	-	-	4,120.08	4,120.08
应收申购款	-	-	-	619,999.13	619,999.13
资产总计	21,241,948.70	-	-	-233,214,912.36	254,456,861.06
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	106,861.38	106,861.38
应付管理人报酬	-	-	-	160,669.78	160,669.78
应付托管费	-	-	-	32,133.95	32,133.95
应付证券清算款	-	-	-	7,495,521.68	7,495,521.68
应付交易费用	-	-	-	145,481.43	145,481.43
其他负债	-	-	-	400,149.41	400,149.41
负债总计	-	-	-	8,340,817.63	8,340,817.63
利率敏感度缺口	21,241,948.70	-	-	-224,874,094.73	246,116,043.43

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 2019 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%

(2018 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(2018 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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

注:无。

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分券和备选成分券，所面临的其他价格风险来源于标的指数成分券和备选成分券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分券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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	294,906,044.34	94.95	232,590,793.15	94.50
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	294,906,044.34	94.95	232,590,793.15	94.50

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)

	动	本期末 (2019 年 6 月 30 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
分析	业绩比较基准上升 5%	14,612,538.02	11,641,358.17
	业绩比较基准下降 5%	-14,612,538.02	-11,641,358.17

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	294,906,044.34	93.67
	其中:股票	294,906,044.34	93.67
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	17,368,565.67	5.52
8	其他各项资产	2,563,204.67	0.81
9	合计	314,837,814.68	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	3,293,887.00	1.06
B	采矿业	10,465,932.78	3.37
C	制造业	165,170,777.46	53.18
D	电力、热力、燃气	9,173,583.97	2.95

	及水生产和供应业		
E	建筑业	5,258,042.76	1.69
F	批发和零售业	15,626,944.34	5.03
G	交通运输、仓储和邮政业	9,856,172.77	3.17
H	住宿和餐饮业	1,143,342.00	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,427,042.90	9.15
J	金融业	12,125,363.24	3.90
K	房地产业	13,773,710.11	4.43
L	租赁和商务服务业	4,043,573.34	1.30
M	科学研究和技术服务业	411,978.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	2,635,981.40	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,001,667.00	0.32
Q	卫生和社会工作	1,807,656.60	0.58
R	文化、体育和娱乐业	6,183,256.00	1.99
S	综合	4,061,202.65	1.31
	合计	294,460,114.32	94.81

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	204,082.40	0.07
C	制造业	179,137.26	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.01
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	-	-
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	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	445,930.02	0.14

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	002405	四维图新	121,900	1,962,590.00	0.63
2	000860	顺鑫农业	40,395	1,884,426.75	0.61
3	600872	中炬高新	43,378	1,857,879.74	0.60
4	002157	正邦科技	92,200	1,536,052.00	0.49
5	002049	紫光国微	33,200	1,464,452.00	0.47
6	300253	卫宁健康	100,785	1,429,131.30	0.46
7	600201	生物股份	90,138	1,414,265.22	0.46
8	000066	中国长城	136,791	1,406,211.48	0.45
9	002195	二三四五	358,121	1,393,090.69	0.45
10	600739	辽宁成大	95,200	1,384,208.00	0.45
11	300450	先导智能	41,100	1,380,960.00	0.44
12	600763	通策医疗	14,900	1,319,991.00	0.43
13	002506	协鑫集成	196,800	1,314,624.00	0.42
14	600426	华鲁恒升	88,467	1,314,619.62	0.42
15	002507	涪陵榨菜	43,000	1,311,500.00	0.42
16	002439	启明星辰	48,700	1,310,030.00	0.42
17	000401	冀东水泥	73,300	1,290,813.00	0.42
18	002127	南极电商	114,450	1,286,418.00	0.41
19	002463	沪电股份	94,019	1,280,538.78	0.41
20	600642	申能股份	212,300	1,275,923.00	0.41
21	002129	中环股份	130,000	1,268,800.00	0.41
22	600183	生益科技	82,500	1,241,625.00	0.40
23	600536	中国软件	23,075	1,238,435.25	0.40
24	600895	张江高科	60,200	1,235,304.00	0.40

25	000975	银泰资源	92,500	1,220,075.00	0.39
26	600298	安琪酵母	38,518	1,218,324.34	0.39
27	002340	格林美	258,115	1,215,721.65	0.39
28	300383	光环新网	71,900	1,205,763.00	0.39
29	002465	海格通信	125,600	1,198,224.00	0.39
30	000623	吉林敖东	72,300	1,184,997.00	0.38
31	002223	鱼跃医疗	46,805	1,152,339.10	0.37
32	002268	卫士通	45,680	1,116,876.00	0.36
33	002384	东山精密	75,034	1,093,245.38	0.35
34	603369	今世缘	39,100	1,090,499.00	0.35
35	002075	沙钢股份	137,200	1,075,648.00	0.35
36	600801	华新水泥	52,930	1,071,832.50	0.35
37	002926	华西证券	102,000	1,071,000.00	0.34
38	002500	山西证券	131,900	1,068,390.00	0.34
39	002821	凯莱英	10,800	1,059,264.00	0.34
40	002385	大北农	197,800	1,046,362.00	0.34
41	600879	航天电子	169,000	1,041,040.00	0.34
42	000998	隆平高科	71,700	1,038,216.00	0.33
43	002797	第一创业	163,400	1,035,956.00	0.33
44	600325	华发股份	131,675	1,028,381.75	0.33
45	600161	天坛生物	40,658	1,026,614.50	0.33
46	600460	士兰微	61,369	1,018,725.40	0.33
47	600497	驰宏锌锗	197,800	1,004,824.00	0.32
48	600528	中铁工业	86,400	999,648.00	0.32
49	000723	美锦能源	95,500	997,975.00	0.32
50	000988	华工科技	62,650	991,123.00	0.32
51	002371	北方华创	14,275	988,543.75	0.32
52	002373	千方科技	57,714	986,909.40	0.32
53	600745	闻泰科技	29,700	986,634.00	0.32
54	002299	圣农发展	38,600	977,352.00	0.31
55	600848	上海临港	31,300	974,369.00	0.31
56	600779	水井坊	19,100	970,662.00	0.31
57	000778	新兴铸管	217,100	963,924.00	0.31
58	000686	东北证券	109,300	962,933.00	0.31
59	600584	长电科技	74,841	961,706.85	0.31
60	000997	新大陆	56,786	959,115.54	0.31
61	000009	中国宝安	167,100	954,141.00	0.31
62	600699	均胜电子	44,400	948,384.00	0.31
63	601168	西部矿业	148,300	946,154.00	0.30
64	600549	厦门钨业	66,000	944,460.00	0.30
65	002572	索菲亚	50,300	933,568.00	0.30
66	601128	常熟银行	120,800	932,576.00	0.30

67	002092	中泰化学	116,868	930,269.28	0.30
68	600572	康恩贝	144,977	927,852.80	0.30
69	600820	隧道股份	146,700	925,677.00	0.30
70	600909	华安证券	140,800	920,832.00	0.30
71	600673	东阳光	117,249	920,404.65	0.30
72	600410	华胜天成	85,695	919,507.35	0.30
73	601005	重庆钢铁	455,800	916,158.00	0.29
74	000060	中金岭南	194,200	910,798.00	0.29
75	600875	东方电气	85,500	908,010.00	0.29
76	600392	盛和资源	81,929	906,134.74	0.29
77	600376	首开股份	100,300	895,679.00	0.29
78	000999	华润三九	30,500	894,870.00	0.29
79	000039	中集集团	82,920	885,585.60	0.29
80	300168	万达信息	67,900	880,663.00	0.28
81	000690	宝新能源	135,360	871,718.40	0.28
82	000960	锡业股份	77,900	870,143.00	0.28
83	000830	鲁西化工	79,727	867,429.76	0.28
84	600718	东软集团	67,600	866,632.00	0.28
85	002353	杰瑞股份	37,300	861,630.00	0.28
86	600166	福田汽车	362,800	859,836.00	0.28
87	600811	东方集团	231,040	859,468.80	0.28
88	600755	厦门国贸	98,813	852,756.19	0.27
89	600022	山东钢铁	510,350	852,284.50	0.27
90	600959	江苏有线	191,500	852,175.00	0.27
91	002372	伟星新材	48,920	851,208.00	0.27
92	601333	广深铁路	263,400	850,782.00	0.27
93	002191	劲嘉股份	68,424	849,141.84	0.27
94	600839	四川长虹	287,000	846,650.00	0.27
95	000581	威孚高科	45,600	846,336.00	0.27
96	600885	宏发股份	34,780	845,154.00	0.27
97	600567	山鹰纸业	249,400	840,478.00	0.27
98	601866	中远海发	308,300	838,576.00	0.27
99	002281	光迅科技	31,660	838,356.80	0.27
100	600804	鹏博士	111,400	837,728.00	0.27
101	000547	航天发展	87,400	835,544.00	0.27
102	002387	维信诺	63,700	831,285.00	0.27
103	002078	太阳纸业	120,928	823,519.68	0.27
104	600521	华海药业	58,400	823,440.00	0.27
105	601872	招商轮船	188,700	822,732.00	0.26
106	600881	亚泰集团	252,468	820,521.00	0.26
107	603939	益丰药房	11,681	817,553.19	0.26
108	600315	上海家化	26,113	813,419.95	0.26

109	002074	国轩高科	61,900	811,509.00	0.26
110	002916	深南电路	7,940	809,244.80	0.26
111	002217	合力泰	145,300	803,509.00	0.26
112	600808	马钢股份	231,900	790,779.00	0.25
113	600486	扬农化工	14,400	787,680.00	0.25
114	603077	和邦生物	411,680	782,192.00	0.25
115	600094	大名城	123,900	779,331.00	0.25
116	300009	安科生物	49,000	779,100.00	0.25
117	600260	凯乐科技	38,959	778,400.82	0.25
118	002273	水晶光电	67,180	777,944.40	0.25
119	600037	歌华有线	75,700	775,925.00	0.25
120	600079	人福医药	73,800	774,900.00	0.25
121	002221	东华能源	89,818	773,332.98	0.25
122	603000	人民网	43,000	766,690.00	0.25
123	002670	国盛金控	60,320	760,032.00	0.24
124	600160	巨化股份	106,680	758,494.80	0.24
125	002038	双鹭药业	32,000	753,920.00	0.24
126	000970	中科三环	66,400	753,640.00	0.24
127	600845	宝信软件	26,260	747,884.80	0.24
128	300027	华谊兄弟	152,100	746,811.00	0.24
129	002002	鸿达兴业	120,638	746,749.22	0.24
130	300274	阳光电源	79,440	742,764.00	0.24
131	002085	万丰奥威	102,000	742,560.00	0.24
132	000983	西山煤电	122,500	742,350.00	0.24
133	300315	掌趣科技	214,300	739,335.00	0.24
134	601699	潞安环能	93,000	738,420.00	0.24
135	000513	丽珠集团	22,169	736,675.87	0.24
136	600967	内蒙一机	65,700	735,840.00	0.24
137	600435	北方导航	81,072	728,837.28	0.23
138	000729	燕京啤酒	109,600	727,744.00	0.23
139	600643	爱建集团	75,772	725,895.76	0.23
140	600143	金发科技	147,800	724,220.00	0.23
141	300088	长信科技	143,000	723,580.00	0.23
142	002607	中公教育	52,700	723,571.00	0.23
143	600737	中粮糖业	83,200	722,176.00	0.23
144	600282	南钢股份	206,300	722,050.00	0.23
145	600466	蓝光发展	116,060	721,893.20	0.23
146	600388	龙净环保	58,200	721,098.00	0.23
147	600064	南京高科	67,322	721,018.62	0.23
148	002110	三钢闽光	76,300	709,590.00	0.23
149	000089	深圳机场	79,800	709,422.00	0.23
150	600863	内蒙华电	225,700	708,698.00	0.23

151	600171	上海贝岭	43,562	707,882.50	0.23
152	600266	北京城建	87,740	707,184.40	0.23
153	300166	东方国信	57,519	706,908.51	0.23
154	601098	中南传媒	55,900	706,576.00	0.23
155	600021	上海电力	81,400	706,552.00	0.23
156	000878	云南铜业	66,200	703,706.00	0.23
157	300001	特锐德	38,900	700,978.00	0.23
158	002174	游族网络	41,500	700,520.00	0.23
159	300207	欣旺达	60,200	693,504.00	0.22
160	603444	吉比特	3,300	692,868.00	0.22
161	002019	亿帆医药	56,400	690,900.00	0.22
162	600026	中远海能	106,456	690,899.44	0.22
163	002131	利欧股份	361,540	690,541.40	0.22
164	603517	绝味食品	17,700	688,707.00	0.22
165	002690	美亚光电	21,100	687,860.00	0.22
166	600258	首旅酒店	38,100	685,038.00	0.22
167	601118	海南橡胶	133,000	684,950.00	0.22
168	000563	陕国投 A	154,132	684,346.08	0.22
169	000636	风华高科	55,800	675,180.00	0.22
170	601106	中国一重	213,200	669,448.00	0.22
171	002440	闰土股份	53,711	669,239.06	0.22
172	600373	中文传媒	53,200	668,192.00	0.22
173	601718	际华集团	170,700	667,437.00	0.21
174	002155	湖南黄金	65,600	660,592.00	0.21
175	002589	瑞康医药	86,910	659,646.90	0.21
176	000883	湖北能源	151,800	658,812.00	0.21
177	000826	启迪桑德	55,700	656,703.00	0.21
178	600380	健康元	75,448	652,625.20	0.21
179	002233	塔牌集团	55,552	648,847.36	0.21
180	000930	中粮生化	86,147	647,825.44	0.21
181	601100	恒立液压	20,600	646,428.00	0.21
182	002152	广电运通	93,600	641,160.00	0.21
183	000732	泰禾集团	38,800	640,200.00	0.21
184	000559	万向钱潮	107,000	639,860.00	0.21
185	002250	联化科技	57,549	638,218.41	0.21
186	600649	城投控股	98,300	636,001.00	0.20
187	601966	玲珑轮胎	37,400	635,800.00	0.20
188	000681	视觉中国	32,800	635,664.00	0.20
189	300316	晶盛机电	50,000	634,500.00	0.20
190	000598	兴蓉环境	139,400	634,270.00	0.20
191	601000	唐山港	230,298	633,319.50	0.20
192	000932	华菱钢铁	131,260	626,110.20	0.20

193	600008	首创股份	176,700	621,984.00	0.20
194	600782	新钢股份	123,900	619,500.00	0.20
195	300182	捷成股份	139,000	612,990.00	0.20
196	600039	四川路桥	168,350	612,794.00	0.20
197	600827	百联股份	62,400	612,144.00	0.20
198	601231	环旭电子	50,800	612,140.00	0.20
199	002399	海普瑞	29,100	610,809.00	0.20
200	600648	外高桥	29,100	610,518.00	0.20
201	600500	中化国际	81,000	605,070.00	0.19
202	600515	海航基础	121,500	601,425.00	0.19
203	002583	海能达	71,500	599,885.00	0.19
204	000738	航发控制	44,600	597,640.00	0.19
205	600748	上实发展	71,700	594,393.00	0.19
206	600598	北大荒	55,300	593,369.00	0.19
207	601179	中国西电	159,400	589,780.00	0.19
208	000758	中色股份	107,200	588,528.00	0.19
209	000685	中山公用	68,874	588,183.96	0.19
210	000031	大悦城	91,583	587,962.86	0.19
211	002266	浙富控股	123,040	584,440.00	0.19
212	002368	太极股份	19,241	583,002.30	0.19
213	601608	中信重工	134,900	582,768.00	0.19
214	603501	韦尔股份	10,600	582,046.00	0.19
215	600729	重庆百货	19,071	576,707.04	0.19
216	000027	深圳能源	92,500	573,500.00	0.18
217	300418	昆仑万维	44,500	572,715.00	0.18
218	002004	华邦健康	117,635	571,706.10	0.18
219	300058	蓝色光标	133,700	570,899.00	0.18
220	000008	神州高铁	151,300	570,401.00	0.18
221	000807	云铝股份	121,600	570,304.00	0.18
222	000877	天山股份	48,948	568,775.76	0.18
223	601678	滨化股份	84,040	568,110.40	0.18
224	600138	中青旅	44,716	567,446.04	0.18
225	600167	联美控股	53,380	564,760.40	0.18
226	600120	浙江东方	44,259	563,859.66	0.18
227	600633	浙数文化	60,300	563,805.00	0.18
228	600056	中国医药	41,594	561,103.06	0.18
229	603228	景旺电子	14,020	560,940.20	0.18
230	000488	晨鸣纸业	103,859	556,684.24	0.18
231	002414	高德红外	28,925	555,360.00	0.18
232	300133	华策影视	82,100	552,533.00	0.18
233	600507	方大特钢	56,400	551,592.00	0.18
234	002183	怡亚通	115,600	551,412.00	0.18

235	603885	吉祥航空	42,000	550,200.00	0.18
236	600511	国药股份	23,892	548,799.24	0.18
237	600777	新潮能源	262,200	545,376.00	0.18
238	600155	华创阳安	40,600	545,258.00	0.18
239	600348	阳泉煤业	93,500	543,235.00	0.17
240	002603	以岭药业	46,900	543,102.00	0.17
241	000887	中鼎股份	56,500	541,835.00	0.17
242	600409	三友化工	95,502	540,541.32	0.17
243	600823	世茂股份	116,700	537,987.00	0.17
244	600216	浙江医药	52,500	537,600.00	0.17
245	600158	中体产业	52,471	536,778.33	0.17
246	002408	齐翔腾达	69,081	535,377.75	0.17
247	000528	柳工	80,280	534,664.80	0.17
248	000813	德展健康	69,800	531,876.00	0.17
249	600418	江淮汽车	102,268	527,702.88	0.17
250	600060	海信电器	61,100	526,682.00	0.17
251	600525	长园集团	82,397	520,749.04	0.17
252	603883	老百姓	8,900	520,472.00	0.17
253	600277	亿利洁能	106,600	519,142.00	0.17
254	002812	恩捷股份	11,100	518,925.00	0.17
255	600970	中材国际	80,550	517,936.50	0.17
256	000301	东方盛虹	94,000	516,060.00	0.17
257	600062	华润双鹤	40,612	512,117.32	0.16
258	600597	光明乳业	47,600	511,700.00	0.16
259	300113	顺网科技	32,561	510,556.48	0.16
260	002701	奥瑞金	108,953	508,810.51	0.16
261	601880	大连港	238,622	508,264.86	0.16
262	002640	跨境通	60,600	504,798.00	0.16
263	002407	多氟多	42,600	504,384.00	0.16
264	600580	卧龙电驱	59,886	503,641.26	0.16
265	300010	立思辰	53,600	503,304.00	0.16
266	600717	天津港	78,360	503,071.20	0.16
267	601958	金钼股份	74,700	500,490.00	0.16
268	600478	科力远	89,248	498,896.32	0.16
269	000090	天健集团	100,913	498,510.22	0.16
270	002244	滨江集团	119,992	497,966.80	0.16
271	002242	九阳股份	23,741	494,050.21	0.16
272	000156	华数传媒	44,600	491,046.00	0.16
273	002212	南洋股份	35,800	490,460.00	0.16
274	600307	酒钢宏兴	241,500	490,245.00	0.16
275	300244	迪安诊断	28,720	487,665.60	0.16
276	000028	国药一致	11,657	487,612.31	0.16

277	600664	哈药股份	117,760	487,526.40	0.16
278	601200	上海环境	35,620	484,788.20	0.16
279	300026	红日药业	140,500	484,725.00	0.16
280	002419	天虹股份	37,100	484,526.00	0.16
281	600312	平高电气	62,812	483,024.28	0.16
282	002056	横店东磁	63,408	481,900.80	0.16
283	300002	神州泰岳	121,000	481,580.00	0.16
284	600316	洪都航空	33,600	480,816.00	0.15
285	603659	璞泰来	10,200	479,604.00	0.15
286	601928	凤凰传媒	59,400	479,358.00	0.15
287	600557	康缘药业	32,090	476,857.40	0.15
288	002426	胜利精密	185,800	475,648.00	0.15
289	601611	中国核建	60,800	473,024.00	0.15
290	600259	广晟有色	11,731	472,759.30	0.15
291	002491	通鼎互联	58,400	472,456.00	0.15
292	002128	露天煤业	54,100	467,965.00	0.15
293	002030	达安基因	43,464	466,368.72	0.15
294	600073	上海梅林	50,676	466,219.20	0.15
295	002665	首航节能	137,005	464,446.95	0.15
296	002470	金正大	126,900	461,916.00	0.15
297	600884	杉杉股份	43,346	461,634.90	0.15
298	000021	深科技	56,756	461,426.28	0.15
299	300134	大富科技	29,630	460,153.90	0.15
300	600125	铁龙物流	71,163	459,001.35	0.15
301	300324	旋极信息	79,222	458,695.38	0.15
302	600754	锦江股份	18,600	458,304.00	0.15
303	600859	王府井	29,949	454,925.31	0.15
304	300197	铁汉生态	126,600	454,494.00	0.15
305	002064	华峰氨纶	90,522	454,420.44	0.15
306	002176	江特电机	92,100	448,527.00	0.14
307	600017	日照港	142,307	448,267.05	0.14
308	600267	海正药业	44,700	447,000.00	0.14
309	603816	顾家家居	14,000	446,880.00	0.14
310	300115	长盈精密	42,485	445,667.65	0.14
311	000078	海王生物	127,877	445,011.96	0.14
312	000712	锦龙股份	34,600	444,264.00	0.14
313	600751	海航科技	138,900	441,702.00	0.14
314	600582	天地科技	127,645	440,375.25	0.14
315	600575	皖江物流	149,800	438,914.00	0.14
316	002051	中工国际	38,232	438,521.04	0.14
317	000727	华东科技	209,600	438,064.00	0.14
318	002358	森源电气	43,012	436,571.80	0.14

319	002302	西部建设	39,000	434,460.00	0.14
320	600563	法拉电子	10,523	433,231.91	0.14
321	600759	洲际油气	111,700	431,162.00	0.14
322	000959	首钢股份	122,400	430,848.00	0.14
323	002424	贵州百灵	43,600	430,768.00	0.14
324	603866	桃李面包	10,280	428,162.00	0.14
325	002317	众生药业	50,302	428,070.02	0.14
326	002285	世联行	94,500	426,195.00	0.14
327	600499	科达洁能	97,300	426,174.00	0.14
328	600291	西水股份	42,200	424,532.00	0.14
329	000400	许继电气	46,700	423,102.00	0.14
330	600901	江苏租赁	69,100	420,819.00	0.14
331	600565	迪马股份	112,800	420,744.00	0.14
332	601717	郑煤机	73,105	417,429.55	0.13
333	002505	大康农业	211,470	416,595.90	0.13
334	000519	中兵红箭	53,708	415,162.84	0.13
335	000158	常山北明	76,500	414,630.00	0.13
336	002444	巨星科技	41,495	414,120.10	0.13
337	600835	上海机电	24,946	414,103.60	0.13
338	600317	营口港	149,800	413,448.00	0.13
339	000717	韶钢松山	93,300	413,319.00	0.13
340	600645	中源协和	23,800	411,978.00	0.13
341	600993	马应龙	23,324	411,668.60	0.13
342	000926	福星股份	59,425	411,221.00	0.13
343	002390	信邦制药	77,200	406,844.00	0.13
344	600770	综艺股份	60,775	405,977.00	0.13
345	000718	苏宁环球	117,000	404,820.00	0.13
346	002573	清新环境	50,052	402,918.60	0.13
347	600908	无锡银行	71,300	402,132.00	0.13
348	601326	秦港股份	110,100	399,663.00	0.13
349	600151	航天机电	77,400	398,610.00	0.13
350	000006	深振业 A	72,907	397,343.15	0.13
351	002249	大洋电机	91,450	396,893.00	0.13
352	000012	南玻 A	94,438	392,862.08	0.13
353	002839	张家港行	69,700	392,411.00	0.13
354	600611	大众交通	84,387	392,399.55	0.13
355	002807	江阴银行	83,780	392,090.40	0.13
356	002280	联络互动	107,000	391,620.00	0.13
357	002831	裕同科技	20,360	390,301.20	0.13
358	000543	皖能电力	82,851	390,228.21	0.13
359	600787	中储股份	67,834	388,688.82	0.13
360	600765	中航重机	41,995	387,613.85	0.12

361	600862	中航高科	43,000	386,570.00	0.12
362	300055	万邦达	53,400	380,742.00	0.12
363	603712	七一二	17,900	380,017.00	0.12
364	603515	欧普照明	11,700	377,325.00	0.12
365	000848	承德露露	45,286	377,232.38	0.12
366	300308	中际旭创	11,080	376,609.20	0.12
367	002366	台海核电	40,200	376,272.00	0.12
368	601019	山东出版	48,300	375,774.00	0.12
369	002028	思源电气	37,324	371,747.04	0.12
370	600141	兴发集团	36,118	371,293.04	0.12
371	000600	建投能源	55,300	370,510.00	0.12
372	600338	西藏珠峰	21,160	369,876.80	0.12
373	600169	太原重工	138,400	369,528.00	0.12
374	600393	粤泰股份	78,300	364,095.00	0.12
375	603233	大参林	8,080	363,600.00	0.12
376	000564	供销大集	139,000	362,790.00	0.12
377	002431	棕榈股份	91,780	362,531.00	0.12
378	601311	骆驼股份	33,354	361,890.90	0.12
379	002093	国脉科技	38,850	360,916.50	0.12
380	002672	东江环保	31,737	359,897.58	0.12
381	002635	安洁科技	26,653	359,548.97	0.12
382	002332	仙琚制药	53,127	359,138.52	0.12
383	300376	易事特	71,800	353,974.00	0.11
384	300287	飞利信	88,600	351,742.00	0.11
385	000980	众泰汽车	83,300	350,693.00	0.11
386	002254	泰和新材	33,044	349,605.52	0.11
387	300297	蓝盾股份	57,900	349,137.00	0.11
388	002048	宁波华翔	32,172	348,101.04	0.11
389	600458	时代新材	33,490	347,961.10	0.11
390	002745	木林森	29,600	346,912.00	0.11
391	601689	拓普集团	22,500	344,700.00	0.11
392	002544	杰赛科技	26,500	344,500.00	0.11
393	600978	宜华生活	91,454	343,867.04	0.11
394	300159	新研股份	69,000	343,620.00	0.11
395	601016	节能风电	128,200	341,012.00	0.11
396	000869	张裕 A	10,500	337,260.00	0.11
397	603198	迎驾贡酒	18,600	333,126.00	0.11
398	603766	隆鑫通用	79,218	331,923.42	0.11
399	600623	华谊集团	43,100	329,284.00	0.11
400	600640	号百控股	24,600	329,148.00	0.11
401	600006	东风汽车	61,743	329,090.19	0.11
402	300266	兴源环境	72,400	328,696.00	0.11

403	300199	翰宇药业	35,800	328,286.00	0.11
404	600195	中牧股份	23,528	325,862.80	0.10
405	000062	深圳华强	24,260	322,415.40	0.10
406	002709	天赐材料	13,300	321,860.00	0.10
407	603888	新华网	16,100	321,356.00	0.10
408	000501	鄂武商 A	29,685	319,113.75	0.10
409	600757	长江传媒	46,800	318,708.00	0.10
410	600639	浦东金桥	19,700	318,549.00	0.10
411	000990	诚志股份	19,400	318,354.00	0.10
412	600694	大商股份	11,400	318,174.00	0.10
413	600750	江中药业	24,369	317,040.69	0.10
414	000937	冀中能源	81,800	315,748.00	0.10
415	603056	德邦股份	22,300	313,984.00	0.10
416	600329	中新药业	21,962	313,836.98	0.10
417	600545	卓郎智能	43,842	311,716.62	0.10
418	000426	兴业矿业	57,640	309,526.80	0.10
419	600869	智慧能源	68,454	309,412.08	0.10
420	603568	伟明环保	14,330	308,381.60	0.10
421	002382	蓝帆医疗	22,300	308,186.00	0.10
422	600416	湘电股份	51,121	307,748.42	0.10
423	002375	亚厦股份	51,700	305,547.00	0.10
424	002815	崇达技术	19,300	300,887.00	0.10
425	000537	广宇发展	43,100	298,252.00	0.10
426	603806	福斯特	8,100	297,513.00	0.10
427	601001	大同煤业	64,600	295,222.00	0.10
428	300257	开山股份	26,500	293,620.00	0.09
429	002920	德赛西威	12,800	286,720.00	0.09
430	601127	小康股份	21,800	285,580.00	0.09
431	000061	农产品	52,400	284,008.00	0.09
432	002503	搜于特	102,600	282,150.00	0.09
433	002434	万里扬	41,400	281,106.00	0.09
434	002489	浙江永强	83,929	280,322.86	0.09
435	600058	五矿发展	33,100	279,695.00	0.09
436	600874	创业环保	33,600	278,544.00	0.09
437	603377	东方时尚	18,200	278,096.00	0.09
438	600707	彩虹股份	55,400	277,554.00	0.09
439	601801	皖新传媒	46,100	277,061.00	0.09
440	002948	青岛银行	42,400	272,632.00	0.09
441	600657	信达地产	66,000	271,920.00	0.09
442	600971	恒源煤电	46,346	271,124.10	0.09
443	000536	华映科技	106,700	268,884.00	0.09
444	002437	誉衡药业	67,855	268,027.25	0.09

445	002118	紫鑫药业	39,496	266,203.04	0.09
446	002517	恺英网络	83,000	264,770.00	0.09
447	000541	佛山照明	49,847	261,198.28	0.08
448	600996	贵广网络	24,200	260,876.00	0.08
449	300459	金科文化	45,600	259,464.00	0.08
450	600098	广州发展	42,100	259,336.00	0.08
451	002707	众信旅游	42,400	257,368.00	0.08
452	002509	天广中茂	124,200	255,852.00	0.08
453	000766	通化金马	37,300	253,640.00	0.08
454	000829	天音控股	43,097	250,824.54	0.08
455	600350	山东高速	52,000	249,600.00	0.08
456	002512	达华智能	54,500	246,340.00	0.08
457	600428	中远海特	66,200	244,940.00	0.08
458	002936	郑州银行	47,600	241,808.00	0.08
459	000552	靖远煤电	88,218	239,070.78	0.08
460	603328	依顿电子	23,108	237,319.16	0.08
461	601869	长飞光纤	6,300	236,250.00	0.08
462	600053	九鼎投资	10,100	235,330.00	0.08
463	600335	国机汽车	33,708	233,259.36	0.08
464	601615	明阳智能	21,300	230,892.00	0.07
465	002482	广田集团	47,500	230,850.00	0.07
466	002344	海宁皮城	49,500	230,670.00	0.07
467	600903	贵州燃气	17,600	229,328.00	0.07
468	601003	柳钢股份	39,600	229,284.00	0.07
469	002251	步步高	28,599	227,934.03	0.07
470	002681	奋达科技	53,057	224,961.68	0.07
471	002818	富森美	17,510	224,653.30	0.07
472	601777	力帆股份	50,728	217,623.12	0.07
473	000587	金洲慈航	81,900	211,302.00	0.07
474	603556	海兴电力	15,260	210,893.20	0.07
475	600939	重庆建工	42,000	205,380.00	0.07
476	000987	越秀金控	21,300	192,126.00	0.06
477	000025	特力A	9,115	184,305.30	0.06
478	002416	爱施德	28,700	179,375.00	0.06
479	600126	杭钢股份	39,100	178,296.00	0.06
480	601969	海南矿业	30,200	177,576.00	0.06
481	600985	淮北矿业	15,100	171,234.00	0.06
482	002699	美盛文化	28,060	168,360.00	0.05
483	601068	中铝国际	23,700	163,530.00	0.05
484	603225	新凤鸣	12,920	161,370.80	0.05
485	600280	中央商场	44,332	159,151.88	0.05
486	601811	新华文轩	12,300	150,183.00	0.05

487	603868	飞科电器	3,700	144,855.00	0.05
488	603486	科沃斯	4,780	144,595.00	0.05
489	002941	新疆交建	5,500	143,000.00	0.05
490	603355	莱克电气	6,200	133,424.00	0.04
491	000761	本钢板材	29,500	126,850.00	0.04
492	002946	新乳业	7,300	110,522.00	0.04
493	603650	彤程新材	5,000	109,200.00	0.04
494	600917	重庆燃气	14,400	100,224.00	0.03
495	603025	大豪科技	8,600	88,064.00	0.03
496	603569	长久物流	6,100	70,699.00	0.02
497	603877	太平鸟	4,500	69,840.00	0.02
498	000612	焦作万方	62	331.08	0.00
499	600086	东方金钰	22	96.80	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	600968	海油发展	57,488	204,082.40	0.07
2	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.03
3	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
4	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.01
5	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
6	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
7	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01
8	000333	美的集团	43	2,229.98	0.00

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	300347	泰格医药	2,016,600.00	0.82
2	002405	四维图新	1,924,031.50	0.78
3	002157	正邦科技	1,594,872.00	0.65
4	600739	辽宁成大	1,384,286.00	0.56
5	600699	均胜电子	1,296,488.00	0.53
6	601005	重庆钢铁	1,288,268.00	0.52
7	600763	通策医疗	1,240,299.00	0.50
8	002075	沙钢股份	1,120,259.00	0.46
9	002926	华西证券	1,072,782.00	0.44
10	600549	厦门钨业	1,041,233.00	0.42
11	600497	驰宏锌锗	1,036,153.00	0.42
12	002797	第一创业	1,028,974.00	0.42

13	600745	闻泰科技	1,010,114.00	0.41
14	002821	凯莱英	970,609.00	0.39
15	002572	索菲亚	904,520.00	0.37
16	002387	维信诺	878,826.00	0.36
17	600909	华安证券	872,118.00	0.35
18	601333	广深铁路	861,900.00	0.35
19	002217	合力泰	839,413.00	0.34
20	300009	安科生物	790,488.00	0.32

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

金额单位:人民币元

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	300347	泰格医药	2,164,438.00	0.88
2	002410	广联达	1,936,043.24	0.79
3	000656	金科股份	1,713,191.00	0.70
4	300146	汤臣倍健	1,655,991.70	0.67
5	600600	青岛啤酒	1,564,244.00	0.64
6	600256	广汇能源	1,429,383.60	0.58
7	300413	芒果超媒	1,291,712.00	0.52
8	000596	古井贡酒	1,184,026.00	0.48
9	603899	晨光文具	1,072,400.00	0.44
10	000333	美的集团	1,009,697.00	0.41
11	002013	中航机电	963,412.24	0.39
12	600655	豫园股份	939,012.00	0.38
13	600507	方大特钢	815,934.00	0.33
14	600779	水井坊	762,989.00	0.31
15	601598	中国外运	723,821.78	0.29
16	000667	美好置业	678,446.42	0.28
17	002174	游族网络	619,174.00	0.25
18	600366	宁波韵升	612,789.20	0.25
19	603658	安图生物	603,608.00	0.25
20	600503	华丽家族	586,399.00	0.24

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	137,408,599.71
卖出股票收入(成交)总额	120,423,169.07

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:本基金本报告期末未持有债券。

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:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

正邦科技

正邦科技 本组合投资的前十名证券之一江西正邦科技股份有限公司 (以下简称“公司”)

关于公司下属分子公司收到《行政处罚决定书》及《责令改正违法行为决定书》的公告本公

公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

近日，江西正邦科技股份有限公司（“公司”）下属子公司肇东正邦养殖有限公司收到肇东市环境保护局出具的《行政处罚决定书》（肇环罚〔2018〕0505 号）、《行政处罚决定书》（肇环罚〔2018〕0607 号）及《责令改正违法行为决定书》（肇环责改字〔2018〕0607 号）；公司下属分公司肇东正邦养殖有限公司红光分公司收到肇东市环境保护局出具的《行政处罚决定书》（肇环罚〔2018〕180506 号）、《行政处罚决定书》（肇环罚〔2018〕0608 号）及《责令改正违法行为决定书》（肇环责改字〔2018〕0608 号）。

公司的整改措施

公司得知上述情况后，第一时间派出专项工作组驻点肇东，查明原因并督导整改。

1、及时缴纳罚款、追加投资、立即整改。接到环保处罚决定书后，公司及时足额缴纳罚款；针对环保部门指出的问题，公司派专人负责，逐项开展整改，确保在规定时间内完成整改，整改工作包括但不限于：检修污水处理设备、搭建堆粪场遮盖棚、维修氧化塘并将废水抽回氧化塘进行处理；为保证将来环保设施的稳定运行，公司将新增投入，增加环保配套，进一步保障环保运行能力。

2、加强管理、强化全公司环保工作的严肃性。公司以上述问题为典型，召开环保专题会议和培训，学习《环保法》、畜禽养殖相关法律法规及主要文件，对养殖场管理人员和环保专职人员培训养殖环保工作操作要点等。公司将环保问题纳入重点考核范围内，对违反行为从重处理。

3、处理相关责任人。查明原因后，对相关责任人进行严肃处理。对黑龙江片区副总进行降职使用，对养殖场场长予以开除。

三、对公司的影响

本次受处罚金额累计为 205 万元，占公司 2017 年度营业收入的 0.01%，占 2017 年度归属于上市公司股东的净利润的 0.39%，占 2017 年底净资产的 0.03%，不会对公司的生产、经营造成重大影响。

此外，公司及分子公司将进一步提高环保意识，在生产过程中持续加强对环保的控制与监督，严格遵守相关法律法规，切实履行环境保护责任。

对上述股票的投资决策程序的说明：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。

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	38,701.01
2	应收证券清算款	2,057,718.26
3	应收股利	-
4	应收利息	3,174.65
5	应收申购款	463,610.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,563,204.67

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

注：无。

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

份额级别	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 (%)
鹏华中证 500 指数 A 类(LOF)	34,071	7,821.75	348,558.60	0.13	266,146,304.89	99.87
鹏华 500 指	381	46,129.79	4,195,415.72	23.87	13,380,032.41	76.13

数 C 类 (LOF)						
合计	34,452	8,245.39	4,543,974.32	1.60	279,526,337.30	98.40

8.2 期末上市基金前十名持有人

鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)

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	3.37
2	高炜	220,300.00	2.68
3	深圳市博凯保健品有限公司	200,028.00	2.43
4	张宏旭	200,012.00	2.43
5	施红梅	197,014.00	2.40
6	卢翠馨	195,030.00	2.37
7	陈亚清	169,584.00	2.06
8	陈吉荃	150,042.00	1.83
9	罗丽珊	148,425.00	1.81
10	邓其学	127,100.00	1.55

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	份额级别	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	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	771,860.24	0.2896
	鹏华 500 指数 C 类 (LOF)	213,726.77	1.2161
	合计	985,587.01	0.3470

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、基金投资和研究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

项目	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	鹏华 500 指数 C 类 (LOF)
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	268,637,138.23	-
本报告期基金总申购份额	169,473,252.70	36,685,327.02
减:本报告期基金总赎回份额	171,615,527.44	19,109,878.89
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	266,494,863.49	17,575,448.13

注:1、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。

2、自 2019 年 1 月 22 日起鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 增加 C 类基金份额。

§ 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

报告期内,基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

无

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	
国信证券	2	151,041,119.70	59.76%	140,005.90	60.16%	-
广发证券	1	51,277,687.11	20.29%	46,729.35	20.08%	-
长江证券	1	49,792,002.00	19.70%	45,375.27	19.50%	-
银河证券	1	642,440.00	0.25%	598.32	0.26%	-

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,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	2018 年第四季度报告	《中国证券报》	2019 年 01 月 21 日
2	关于鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 和鹏华中证 500 指数证券投资	《中国证券报》	2019 年 01 月 22 日

	基金 (LOF) 新增 C 类基金份额并修改基金合同的公告		
3	关于鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 和鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 新增 C 类基金份额并修改基金合同的公告	《上海证券报》	2019 年 01 月 22 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在浙江金观诚基金销售有限公司暂停办理相关销售业务的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2019 年 01 月 22 日
5	鹏华基金管理有限公司关于在网上直销及直销柜台渠道开展旗下指定货币基金与指数基金、指数基金之间转换费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2019 年 02 月 01 日
6	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	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2019 年 02 月 12 日
7	鹏华基金管理有限公司关于增加招商证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》	2019 年 02 月 13 日
8	鹏华基金管理有限公司关于增加世纪证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》	2019 年 02 月 19 日
9	鹏华基金管理有限公司关于增加联讯证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》	2019 年 02 月 19 日
10	鹏华基金管理有限公司关于增加南京证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》	2019 年 02 月 21 日
11	鹏华基金管理有限公司关于增加中国银河证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》	2019 年 02 月 21 日
12	鹏华基金管理有限公司关于增加腾安基金销售 (深圳) 有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2019 年 02 月 22 日
13	鹏华基金管理有限公司关于增加华泰证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》	2019 年 02 月 25 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	《证券时报》	2019 年 02 月 26 日
15	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》	2019 年 02 月 26 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金	《上海证券报》	2019 年 02 月 26 日

	持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告		
17	鹏华基金管理有限公司关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 02 月 27 日
18	鹏华基金管理有限公司关于增加北京恒天明泽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》	2019 年 02 月 27 日
19	鹏华基金管理有限公司关于增加海银基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 02 月 27 日
20	鹏华基金管理有限公司关于增加海银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》	2019 年 02 月 27 日
21	鹏华基金管理有限公司关于增加长江证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 01 日
22	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券时报》	2019 年 03 月 01 日
23	鹏华基金管理有限公司关于增加财通证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 01 日
24	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 01 日
25	鹏华基金管理有限公司关于增加财通证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 01 日
26	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《证券日报》	2019 年 03 月 01 日
27	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 01 日
28	鹏华基金管理有限公司关于增加长江证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 01 日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与财通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	《上海证券报》	2019 年 03 月 04 日
30	鹏华基金管理有限公司关于增加平安证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 04 日
31	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与财通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》	2019 年 03 月 04 日
32	鹏华基金管理有限公司关于增加平安证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 04 日

33	鹏华基金管理有限公司关于增加华安证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 05 日
34	鹏华基金管理有限公司关于增加华安证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 05 日
35	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙商银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019 年 03 月 12 日
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙商银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 12 日
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙商银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 12 日
38	鹏华基金管理有限公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券日报》	2019 年 03 月 13 日
39	鹏华基金管理有限公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019 年 03 月 13 日
40	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 13 日
41	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019 年 03 月 13 日
42	鹏华基金管理有限公司关于增加浙江同花顺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》	2019 年 03 月 13 日
43	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《证券日报》	2019 年 03 月 13 日
44	鹏华基金管理有限公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 13 日
45	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司认\申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 13 日
46	鹏华基金管理有限公司关于增加信达证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 14 日
47	鹏华基金管理有限公司关于增加信达证券股份有限公司为旗下部分基金销	《上海证券报》	2019 年 03 月 14 日

	售机构的公告		
48	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》	2019 年 03 月 16 日
49	鹏华基金管理有限公司关于增加大同证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 18 日
50	鹏华基金管理有限公司关于增加大同证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 18 日
51	鹏华基金管理有限公司关于增加首创证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 22 日
52	鹏华基金管理有限公司关于增加首创证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 22 日
53	鹏华基金管理有限公司关于增加上海证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 22 日
54	鹏华基金管理有限公司关于增加首创证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019 年 03 月 22 日
55	鹏华基金管理有限公司关于增加上海证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 03 月 22 日
56	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国信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	《证券时报》	2019 年 03 月 27 日
57	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国信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	《上海证券报》	2019 年 03 月 27 日
58	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国信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	《证券日报》	2019 年 03 月 27 日
59	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国信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》	2019 年 03 月 27 日
60	2018 年年度报告摘要	《中国证券报》	2019 年 03 月 28 日
61	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申	《上海证券报》	2019 年 03 月 30 日

	购费率优惠的公告		
62	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申购费率优惠的公告	《中国证券报》	2019 年 03 月 30 日
63	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申购费率优惠的公告	《证券日报》	2019 年 03 月 30 日
64	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申购费率优惠的公告	《证券时报》	2019 年 03 月 30 日
65	鹏华基金管理有限公司关于增加五矿证券有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 04 月 01 日
66	鹏华基金管理有限公司关于增加五矿证券有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 04 月 01 日
67	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	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2019 年 04 月 08 日
68	鹏华基金管理有限公司关于增加北京唐鼎耀华基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2019 年 04 月 11 日
69	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	《证券时报》	2019 年 04 月 13 日
70	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	《上海证券报》	2019 年 04 月 13 日
71	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》	2019 年 04 月 13 日
72	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	《证券日报》	2019 年 04 月 13 日
73	2019 年第一季度报告	《中国证券报》	2019 年 04 月 19 日
74	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	《上海证券报》	2019 年 04 月 23 日
75	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》	2019 年 04 月 23 日

76	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	《证券时报》	2019 年 04 月 23 日
77	鹏华基金管理有限公司关于增加国盛证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019 年 04 月 30 日
78	鹏华基金管理有限公司关于增加国盛证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 04 月 30 日
79	鹏华基金管理有限公司关于增加国盛证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 04 月 30 日
80	鹏华基金管理有限公司关于增加国盛证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券日报》	2019 年 04 月 30 日
81	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》	2019 年 05 月 07 日
82	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	《证券日报》	2019 年 05 月 07 日
83	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	《上海证券报》	2019 年 05 月 07 日
84	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	《证券时报》	2019 年 05 月 07 日
85	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	《证券时报》	2019 年 05 月 13 日
86	鹏华基金管理有限公司关于增加上海天天基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019 年 05 月 13 日
87	鹏华基金管理有限公司关于增加上海天天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》	2019 年 05 月 13 日
88	鹏华基金管理有限公司关于增加上海天天基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 05 月 13 日
89	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	《上海证券报》	2019 年 05 月 13 日
90	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公	《证券日报》	2019 年 05 月 13 日

	告		
91	鹏华基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	《中国证券报》	2019 年 05 月 13 日
92	鹏华基金管理有限公司关于增加国金证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》	2019 年 05 月 16 日
93	鹏华基金管理有限公司关于增加国金证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 05 月 16 日
94	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	《证券时报》	2019 年 05 月 18 日
95	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	《证券日报》	2019 年 05 月 18 日
96	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》	2019 年 05 月 18 日
97	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	《上海证券报》	2019 年 05 月 18 日
98	鹏华基金管理有限公司关于增加上海挖财基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券日报》	2019 年 05 月 22 日
99	鹏华基金管理有限公司关于增加上海挖财基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019 年 05 月 22 日
100	鹏华基金管理有限公司关于增加上海挖财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》	2019 年 05 月 22 日
101	鹏华基金管理有限公司关于增加上海挖财基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 05 月 22 日
102	鹏华基金管理有限公司关于北京恒天明泽基金销售有限公司终止销售本公司旗下部分基金的公告	《证券日报》	2019 年 05 月 22 日
103	鹏华基金管理有限公司关于增加上海好买基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019 年 06 月 17 日
104	鹏华基金管理有限公司关于增加宜信普泽 (北京) 基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019 年 06 月 17 日
105	鹏华基金管理有限公司关于增加宜信	《上海证券报》	2019 年 06 月 17 日

	普泽 (北京) 基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告		
106	鹏华基金管理有限公司关于增加诺亚正行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》	2019 年 06 月 17 日
107	鹏华基金管理有限公司关于增加上海好买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》	2019 年 06 月 17 日
108	鹏华基金管理有限公司关于增加上海好买基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 06 月 17 日
109	鹏华基金管理有限公司关于增加宜信普泽 (北京) 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》	2019 年 06 月 17 日
110	鹏华基金管理有限公司关于增加上海好买基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券日报》	2019 年 06 月 17 日
111	鹏华基金管理有限公司关于增加诺亚正行基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券日报》	2019 年 06 月 17 日
112	鹏华基金管理有限公司关于增加诺亚正行基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《证券时报》	2019 年 06 月 17 日
113	鹏华基金管理有限公司关于增加诺亚正行基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《上海证券报》	2019 年 06 月 17 日
114	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《上海证券报》	2019 年 06 月 20 日
115	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《证券时报》	2019 年 06 月 20 日
116	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《证券日报》	2019 年 06 月 20 日
117	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《中国证券报》	2019 年 06 月 20 日
118	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公司认、申购 (含定期定额申购) 费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019 年 06 月 24 日
119	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公司认、申购 (含定期定额申购) 费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 06 月 24 日
120	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公	《证券日报》	2019 年 06 月 24 日

	司认、申购 (含定期定额申购) 费率优惠活动的公告		
121	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与徽商银行股份有限公司认、申购 (含定期定额申购) 费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019 年 06 月 24 日
122	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	《上海证券报》	2019 年 06 月 26 日
123	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》	2019 年 06 月 26 日
124	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	《证券日报》	2019 年 06 月 26 日
125	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	《证券时报》	2019 年 06 月 26 日
126	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《证券日报》	2019 年 06 月 27 日
127	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019 年 06 月 27 日
128	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019 年 06 月 27 日
129	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019 年 06 月 27 日

§ 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）2019 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>）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

2019 年 8 月 23 日