

鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 30 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。本中期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 2021 年 08 月 27 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
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	11
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
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	17
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62

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	62
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	62
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	62
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	62
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§ 8 基金份额持有人信息.....	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末上市基金前十名持有人	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	65
§ 9 开放式基金份额变动.....	65
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证 500
场内简称	中证 500ETF 鹏华
基金主代码	159982
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 11 月 21 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	220,211,253.00 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	2020 年 2 月 20 日

注：无。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年跟踪误差控制在 2% 以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、股票投资策略（1）股票投资组合的构建 本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。（2）股票投资组合的调整 本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况，对其进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将</p>

	<p>对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。</p> <p>1) 定期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。</p> <p>2) 不定期调整 根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整；根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>(3) 存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>2. 债券投资策略 本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。</p> <p>3. 股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。</p> <p>4. 资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p> <p>5. 参与融资及转融通证券出借业务策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。本基金将密切跟踪国内关于基金参与融券业务法律法规的实施进展，待允许本基金参与融券业务的相关规定颁布后，将在届时相应法律法规的框架内，参与融券业务。未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，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。同时本基金为交易型开放式指数基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。</p>

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	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	26,941,977.27
本期利润	34,807,999.34
加权平均基金份额本期利润	0.1701
本期加权平均净值利润率	12.17%
本期基金份额净值增长率	12.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	96,247,740.18
期末可供分配基金份额利润	0.4371
期末基金资产净值	332,953,022.57
期末基金份额净值	1.5120
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	51.20%

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。

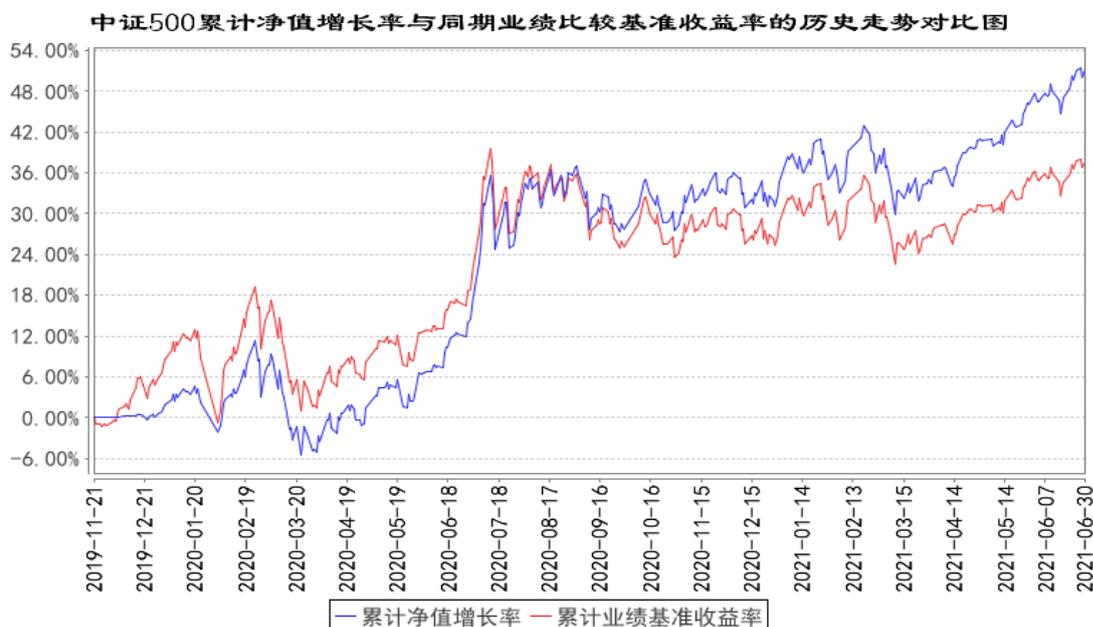
3.2 基金净值表现

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	2.61%	0.74%	1.18%	0.73%	1.43%	0.01%
过去三个月	12.41%	0.67%	8.86%	0.68%	3.55%	-0.01%
过去六个月	12.23%	0.97%	6.93%	0.99%	5.30%	-0.02%
过去一年	32.67%	1.24%	16.09%	1.25%	16.58%	-0.01%
自基金合同生效起至今	51.20%	1.28%	37.64%	1.41%	13.56%	-0.13%

注：业绩比较基准=中证 500 指数收益率

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



注：1、本基金基金合同于 2019 年 11 月 21 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。截至本报告期末，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，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模达到 9,012.31 亿元，管理 237 只公募基金、13 只全国社保投资组合、4 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富的经验。

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		

陈龙	基金经理	2019-11-21	-	12 年	<p>陈龙先生，国籍中国，经济学硕士，12 年证券从业经验。曾任杭州衡泰软件公司金融工程师，2009 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部金融工程总监助理、量化及衍生品投资部量化研究总监助理，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量化研究副总经理、基金经理。2015 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 07 月至 2018 年 04 月担任鹏华创业板指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 04 月担任鹏华中证 800 地产指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华港股通中证香港中小企业投资主题指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 04 月担任鹏华中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至今担任鹏华中证空天一体军工指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 11 月至今担任鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019 年 12 月至今担任鹏华国证证券龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 01 月至今担任鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2021 年 01 月至今担任鹏华中证 800 证券保险指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2021 年 01 月至今担任鹏华中证全指证券公司指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2021 年 01 月至今担任鹏华中证国防指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2021 年 02 月至今担任鹏华中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金基金经理，陈龙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。</p>
----	------	------------	---	------	---

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

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% 的交易次数为 2 次，主要原因在于指数基金成分股交易不活跃导致。

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

报告期内，上证指数上涨 3.40%，深证成指上涨 4.78%，本基金跟踪的中证 500 指数上涨 6.93%。截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为 12.23%，同期业绩比较基准增长率为 6.93%，基金年化跟踪误差为 0.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年上半年，全球疫情呈现非对称的状态。发达国家由于疫苗接种情况良好，疫情得到有效的控制，经济开始出现复苏的态势；而发展中国家仍有零星爆发，全球的供给仍存在显著的抑制。

国内经济延续复苏的态势，受益于海外非对称的疫情形势，出口仍然延续的高增长的态势，成为

本轮经济复苏的重要驱动因素。房地产由于持续收紧的调控政策而呈现前高后低的局面。

上半年股票市场经历了宽幅震荡，一季度各行业均经历了系统性的调整，而二季度则呈现较为严重的分化行情。部分核心资产的衰落及赛道股的崛起是 4 月份以来这轮行情的重要特征，其背景在于，拉长时间看经济复苏的不确定性带来核心资产盈利不确定性，使得市场转而追求新能源（车）、半导体芯片、医美、国防军工等长期景气度更确定的赛道方向。

展望下半年，疫情在全球范围内得到控制仍然是大概率的情景，全球经济仍然会延续复苏的趋势，尤其是发展中国家。美联储会开始讨论货币政策退出的问题，但是最终可能会是“覆水难收”的局面。全球的视角，资本市场会面临一定的波动，但是总体上不会有系统性的风险。

回到国内，作为本轮经济复苏的两架重要的马车——出口和房地产，下半年都会面临不小压力，叠加消费的疲软，使得下半年经济下行的压力比较大。宏观政策会及时进行对冲，最近央行已经开展一次全面的降准，后续有望通过连续的降准来置换存量 MLF。这样的宏观经济和政策的组合，至少可以保证资本市场不会出现系统性的风险。

总体上，我们认为市场仍然会呈现结构性行情。进攻的方向，需要特别重视高端制造，包括新能源（车）、半导体芯片及国防军工等，这三个方向也是未来可见的能维持较高景气度的方向。在中美脱钩的背景下，制造业的自主可控已经上升为国家战略，而服务业则会受到一定程度的抑制，近期对互联网平台可略见端倪。防御的角度，可以阶段性的关注大金融的机会，毕竟目前大金融整体估值在极低的位置，当高景气方向出现调整时，大金融会起到指数稳定器的作用。

本基金将积极应对各种因素指数跟踪效果带来的冲击，努力使得跟踪误差控制在基金合同规定的范围内，力争为投资者带来超越指数收益回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，由登记结算部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、

假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

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 96,247,740.18 元，期末基金份额净值 1.5120 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 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，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 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、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。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,454,819.36	6,112,217.19
结算备付金		9,787,958.66	10,499,196.60
存出保证金		2,292,595.79	1,875,769.48
交易性金融资产	6.4.7.2	310,302,859.14	235,625,652.76
其中：股票投资		310,302,859.14	235,625,652.76
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		481,882.83	464,865.39
应收利息	6.4.7.5	4,979.63	2,397.66
应收股利		2,608.66	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		333,327,704.07	254,580,099.08
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020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		-	22,791.03
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		38,775.66	33,427.10
应付托管费		12,925.24	11,142.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	135,143.35	226,959.85
应交税费		66,056.80	9,191.52
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	121,780.45	715,510.06
负债合计		374,681.50	1,019,021.92
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	220,211,253.00	188,211,253.00

未分配利润	6.4.7.10	112,741,769.57	65,349,824.16
所有者权益合计		332,953,022.57	253,561,077.16
负债和所有者权益总计		333,327,704.07	254,580,099.08

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.5120 元，基金份额总额 220,211,253.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 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
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		35,603,504.91	41,487,686.60
1. 利息收入		74,304.18	143,387.99
其中：存款利息收入	6.4.7.11	36,904.08	142,141.49
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		-	-
证券出借利息收入		37,400.10	1,246.50
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		27,479,856.88	33,318,842.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	23,502,083.83	31,453,108.86
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	1,497,980.58	375,921.04
股利收益	6.4.7.16	2,479,792.47	1,489,812.70
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,867,316.82	6,979,261.20
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	182,027.03	1,046,194.81
减：二、费用		795,505.57	1,915,826.90
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	211,643.68	261,027.62
2. 托管费	6.4.10.2.2	70,547.92	87,009.20

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	349,378.21	1,408,611.36
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		6,822.31	4,397.36
7. 其他费用	6.4.7.20	157,113.45	154,781.36
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		34,807,999.34	39,571,859.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		34,807,999.34	39,571,859.70

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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)	188,211,253.00	65,349,824.16	253,561,077.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	34,807,999.34	34,807,999.34
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)	32,000,000.00	12,583,946.07	44,583,946.07
其中：1. 基金申购款	82,000,000.00	32,771,618.72	114,771,618.72
2. 基金赎回款	-50,000,000.00	-20,187,672.65	-70,187,672.65
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)	220,211,253.00	112,741,769.57	332,953,022.57

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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)	490,211,253.00	4,090,427.68	494,301,680.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	39,571,859.70	39,571,859.70
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)	-330,000,000.00	-21,286,891.00	-351,286,891.00
其中：1. 基金申购款	170,000,000.00	13,975,072.10	183,975,072.10
2. 基金赎回款	-500,000,000.00	-35,261,963.10	-535,261,963.10
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)	160,211,253.00	22,375,396.38	182,586,649.38

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

邢彪

郝文高

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 交易型开放式指数证券投资基金(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[2019]第 1504 号《关于准予鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 490,173,730.00 元(含募集股票市值),经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中

天验字(2019)第 0669 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 11 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 490,211,253.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 37,523.00 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[2020]99 号文审核同意,本基金 490,211,253.00 份基金份额于 2020 年 2 月 20 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的标的指数为中证 500 指数,投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化;主要投资范围为标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的股票、存托凭证)、债券(含国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等)、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股和备选成份股(含存托凭证)的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内,年跟踪误差控制在 2%以内。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率。

本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,于 2020 年 1 月 15 日募集成立了鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“鹏华中证 500ETF 联接基金”)。鹏华中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

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<年度报告和中期报告>》、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 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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 2021 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 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	10,454,819.36
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	10,454,819.36

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	294,267,224.82	310,302,859.14	16,035,634.32
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		294,267,224.82	310,302,859.14	16,035,634.32

注：股票投资的公允价值和股票投资的公允价值变动均含可退替代款估值增值。

股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	15,465,240.00	-	-	
其中：股指期货投资	15,465,240.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	15,465,240.00	-	-	

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 2021年6月30日
应收活期存款利息	844.21
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	2,575.33
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	-
应收出借证券利息	1,538.85
其他	21.24
合计	4,979.63

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 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	135,143.35
银行间市场应付交易费用	-
合计	135,143.35

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	86,780.45
应付指数使用费	35,000.00
合计	121,780.45

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	188,211,253.00	188,211,253.00
本期申购	82,000,000.00	82,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-50,000,000.00	-50,000,000.00
- 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	220,211,253.00	220,211,253.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

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	57,481,437.92	7,868,386.24	65,349,824.16
本期利润	26,941,977.27	7,866,022.07	34,807,999.34
本期基金份额交易产生的变动数	11,824,324.99	759,621.08	12,583,946.07
其中：基金申购款	28,709,269.41	4,062,349.31	32,771,618.72
基金赎回款	-16,884,944.42	-3,302,728.23	-20,187,672.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	96,247,740.18	16,494,029.39	112,741,769.57

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	16,064.51
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	20,079.04
其他	760.53
合计	36,904.08

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	22,057,721.39
股票投资收益——赎回差价收入	1,444,362.44
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	23,502,083.83

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	102,081,796.77
减：卖出股票成本总额	80,024,075.38

买卖股票差价收入	22,057,721.39
----------	---------------

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	70,187,672.65
减：现金支付赎回款总额	33,614,379.65
减：赎回股票成本总额	35,128,930.56
赎回差价收入	1,444,362.44

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	1,497,980.58

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,479,792.47
其中：证券出借权益补偿收入	59,141.29
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,479,792.47

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
------	----------------------------

1. 交易性金融资产	7,507,666.34
股票投资	7,507,666.34
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	370,440.00
权证投资	-
期货投资	370,440.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	10,789.52
合计	7,867,316.82

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	182,027.03
合计	182,027.03

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	349,378.21
银行间市场交易费用	-
合计	349,378.21

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	333.00
指数使用费	70,000.00
合计	157,113.45

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金的一级交易商
鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“鹏华中证 500ETF 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	72,523,390.88	31.77	469,296,540.91	48.88

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 2021年1月1日至2021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	66,090.73	31.81	50,714.66	37.53
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	427,677.60	49.65	-	-

注：（1）佣金的计算公式

上海/深圳证券交易所的交易佣金=股票买(卖)成交金额×佣金比率-买(卖)经手费-买(卖)证管费等由券商承担的费用

(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约定的佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。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 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	211,643.68
其中: 支付销售机构的客户维护费	521.19	37,364.95

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.15%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.15%÷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
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	70,547.92	87,009.20

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费年费率为 0.05%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.05%÷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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期				
2021年1月1日至2021年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-
上年度可比期间				
2020年1月1日至2020年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国信证券	2,030,220.00	1,283.84	1,248,300.00	764.01

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	10,454,819.36	16,064.51	4,004,491.08	131,460.36

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
国信证券	300957	贝泰妮	网下申购	1,898	89,832.34
国信证券	300986	志特新材	网下申购	2,632	38,927.28
国信证券	688323	瑞华泰	网下申购	4,513	26,942.61
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
-	-	-	-	-	-

注：本基金在上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 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(2021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
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	锁定期股票	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年07月02日	锁定期股票	24.60	163.00	275	6,765.00	44,825.00	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年07月21日	锁定期股票	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	锁定期股票	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	锁定期股票	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	锁定期股票	24.69	31.71	438	10,814.22	13,888.98	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	锁定期股票	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	锁定期股票	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	锁定期股票	21.31	49.94	287	6,115.97	14,332.78	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	锁定期股票	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	锁定期股票	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	锁定期股票	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-

300948	冠中生态	2021年 2月18 日	2021年 8月25 日	锁定期 股票	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021年 2月24 日	2021年 9月3 日	锁定期 股票	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021年 3月3日	2021年 9月13 日	锁定期 股票	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300957	贝泰妮	2021年 3月18 日	2021年 9月27 日	锁定期 股票	47.33	251.96	190	8,992.70	47,872.40	-
300958	建工修复	2021年 3月18 日	2021年 9月29 日	锁定期 股票	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021年 3月22 日	2021年 9月29 日	锁定期 股票	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年 3月23 日	2021年 9月30 日	锁定期 股票	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年 3月29 日	2021年 10月 11日	锁定期 股票	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021年 3月30 日	2021年 10月 11日	锁定期 股票	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021年 3月31 日	2021年 10月 11日	锁定期 股票	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年 4月2日	2021年 10月 13日	锁定期 股票	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021年 4月6日	2021年 10月 15日	锁定期 股票	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021年 4月7日	2021年 10月 15日	锁定期 股票	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021年 4月8日	2021年 10月 19日	锁定期 股票	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021年 4月8日	2021年 10月	锁定期 股票	28.28	115.71	255	7,211.40	29,506.05	-

			15 日							
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	锁定期 股票	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	锁定期 股票	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	锁定期 股票	33.22	87.50	343	11,394.46	30,012.50	-
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	锁定期 股票	48.59	90.39	228	11,078.52	20,608.92	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	锁定期 股票	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	锁定期 股票	24.90	24.81	283	7,046.70	7,021.23	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	锁定期 股票	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	锁定期 股票	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	锁定期 股票	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	锁定期 股票	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	锁定期 股票	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	锁定期 股票	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	锁定期 股票	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	锁定期 股票	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛	2021 年	2021 年	锁定期	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-

	股份	5月27日	12月7日	股票							
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	锁定期股票	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-	
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	锁定期股票	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-	
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	锁定期股票	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-	
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	锁定期股票	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-	
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	锁定期股票	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-	
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	锁定期股票	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-	
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	锁定期股票	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-	
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	锁定期股票	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-	
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-	
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	锁定期股票	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-	
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-	
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	锁定期股票	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-	
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-	
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	锁定期股票	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-	

605162	新中港	2021年 6月29 日	2021年 7月7 日	新股未 上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688059	华锐精密	2021年 2月1日	2021年 8月9 日	锁定期 股票	37.09	160.26	1,023	37,943.07	163,945.98	-
688079	美迪凯	2021年 2月23 日	2021年 9月2 日	锁定期 股票	10.19	18.40	6,897	70,280.43	126,904.80	-
688087	英科再生	2021年 6月30 日	2021年 7月9 日	新股未 上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688201	信安世纪	2021年 4月13 日	2021年 10月 21日	锁定期 股票	26.78	45.41	2,129	57,014.62	96,677.89	-
688226	威腾电气	2021年 6月28 日	2021年 7月7 日	新股未 上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021年 6月25 日	2021年 7月5 日	新股未 上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688260	昀冢科技	2021年 3月25 日	2021年 10月8 日	锁定期 股票	9.63	16.41	2,990	28,793.70	49,065.90	-
688314	康拓医疗	2021年 5月11 日	2021年 11月 18日	锁定期 股票	17.34	74.48	1,085	18,813.90	80,810.80	-
688316	青云科技-U	2021年 3月5日	2021年 9月16 日	锁定期 股票	63.70	65.00	1,142	72,745.40	74,230.00	-
688468	科美诊断	2021年 3月31 日	2021年 10月 11日	锁定期 股票	7.15	16.50	3,919	28,020.85	64,663.50	-
688609	九联科技	2021年 3月15 日	2021年 9月23 日	锁定期 股票	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88	-
688617	惠泰医疗	2020年 12月30 日	2021年 7月7 日	锁定期 股票	74.46	373.24	1,070	79,672.20	399,366.80	-
688665	四方光电	2021年 2月2日	2021年 8月9 日	锁定期 股票	29.53	129.46	1,687	49,817.11	218,399.02	-

			日							
688690	纳微科技	2021年6月16日	2021年12月23日	锁定期股票	8.07	79.89	3,477	28,059.39	277,777.53	-

注：1、根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起约定限售期内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的科创板股票，在受让后6个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，本基金参与摇号配售或比例配售方式获配的创业板股票自发行人股票上市之日起在发行人约定的限售期内不得转让。

5、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6、冠中生态于2021年6月4日实施权益分派方案，每10股派人民币0.8元，并转增5股。

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
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项	56.35	2021年7月1日	59.49	38,900	893,473.45	2,192,015.00	-
600811	东方集团	2021年6月30日	重大事项	3.05	2021年7月14日	3.36	147,000	549,818.86	448,350.00	-

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
1	000027	深圳能源	2021年7月14日	9.17	16,000	146,720.00
2	000158	常山北明	2021年7月14日	11.49	10,000	114,900.00
3	000402	金融街	2021年7月14日	6.75	13,000	87,750.00
4	000488	晨鸣纸业	2021年7月9日	8.14	14,000	113,960.00
5	000717	韶钢松山	2021年7月12日	4.59	14,000	64,260.00
6	000718	苏宁环球	2021年7月14日	8.29	17,000	140,930.00
7	000813	德展健康	2021年7月12日	4.54	10,000	45,400.00
8	000825	太钢不锈钢	2021年7月14日	7.49	26,000	194,740.00
9	000830	鲁西化工	2021年7月14日	18.73	12,000	224,760.00
10	000883	湖北能源	2021年7月14日	4.59	22,000	100,980.00
11	000932	华菱钢铁	2021年7月5日-2021年7月14日	6.60	34,000	224,400.00
12	000937	冀中能源	2021年7月12日	3.93	12,000	47,160.00
13	000960	锡业股份	2021年7月12日	16.03	11,000	176,330.00
14	002002	鸿达兴业	2021年7月5日-2021年7月14日	3.93	32,000	125,760.00
15	002004	华邦健	2021年7月14日	6.21	18,000	111,780.00

		康				0
16	002078	太阳纸业	2021 年 7 月 9 日	13.35	18,000	240,300.00
17	002092	中泰化学	2021 年 7 月 5 日	10.27	20,000	205,400.00
18	002152	广电运通	2021 年 7 月 5 日	13.03	14,000	182,420.00
19	002249	大洋电机	2021 年 7 月 12 日	5.25	19,000	99,750.00
20	002408	齐翔腾达	2021 年 7 月 5 日	12.42	10,000	124,200.00
21	300010	豆神教育	2021 年 7 月 5 日	5.67	7,000	39,690.00
22	300113	顺网科技	2021 年 7 月 12 日	12.94	5,000	64,700.00
23	300182	捷成股份	2021 年 7 月 5 日	4.99	24,000	119,760.00
24	300207	欣旺达	2021 年 7 月 5 日	32.56	12,000	390,720.00
25	300257	开山股份	2021 年 7 月 12 日	14.37	4,000	57,480.00
26	600126	杭钢股份	2021 年 7 月 9 日	5.13	15,000	76,950.00
27	600160	巨化股份	2021 年 7 月 12 日	8.84	15,000	132,600.00
28	600260	凯乐科技	2021 年 7 月 12 日	8.88	11,000	97,680.00
29	600307	酒钢宏兴	2021 年 7 月 5 日-2021 年 7 月 14 日	2.32	41,000	95,120.00
30	600392	盛和资源	2021 年 7 月 12 日	17.36	14,000	243,040.00
31	600410	华胜天成	2021 年 7 月 5 日	7.76	12,000	93,120.00
32	600418	江淮汽车	2021 年 7 月 5 日	12.43	15,000	186,450.00
33	600435	北方导航	2021 年 7 月 5 日	7.94	10,000	79,400.00
34	600704	物产中大	2021 年 7 月 5 日	7.87	35,000	275,450.00
35	600707	彩虹股份	2021 年 7 月 5 日	9.41	16,000	150,560.00
36	600733	北汽蓝谷	2021 年 7 月 5 日	13.48	24,000	323,520.00
37	600804	鹏博士	2021 年 7 月 5 日	4.84	16,000	77,440.00

38	600968	海油发展	2021 年 7 月 12 日	2.59	24,000	62,160.00
39	601016	节能风电	2021 年 7 月 5 日-2021 年 7 月 14 日	3.74	41,000	153,340.00
40	601168	西部矿业	2021 年 7 月 14 日	11.93	21,000	250,530.00
41	601198	东兴证券	2021 年 7 月 12 日	10.93	16,000	174,880.00
合计	-	-	-	-	720,000	5,916,490.00

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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券；以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，因此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 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2020 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均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，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。

于 2021 年 6 月 30 日，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%。

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未来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主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，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 2021 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	10,454,819.36	-	-	-	10,454,819.36
结算备付金	9,787,958.66	-	-	-	9,787,958.66
存出保证金	2,292,595.79	-	-	-	2,292,595.79
交易性金融资产	-	-	-	310,302,859.14	310,302,859.14
应收利息	-	-	-	4,979.63	4,979.63
应收股利	-	-	-	2,608.66	2,608.66
应收证券清算款	-	-	-	481,882.83	481,882.83
资产总计	22,535,373.81	-	-	310,792,330.26	333,327,704.07
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	38,775.66	38,775.66
应付托管费	-	-	-	12,925.24	12,925.24
应付交易费用	-	-	-	135,143.35	135,143.35
应交税费	-	-	-	66,056.80	66,056.80
其他负债	-	-	-	121,780.45	121,780.45
负债总计	-	-	-	374,681.50	374,681.50
利率敏感度缺口	22,535,373.81	-	-	-310,417,648.76	332,953,022.57
上年度末 2020 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	6,112,217.19	-	-	-	6,112,217.19
结算备付金	10,499,196.60	-	-	-	10,499,196.60

存出保证金	1,875,769.48	-	-	1,875,769.48
交易性金融资产	-	-	-235,625,652.76	235,625,652.76
应收利息	-	-	2,397.66	2,397.66
应收证券清算款	-	-	464,865.39	464,865.39
资产总计	18,487,183.27	-	-236,092,915.81	254,580,099.08
负债				
应付管理人报酬	-	-	33,427.10	33,427.10
应付托管费	-	-	11,142.36	11,142.36
应付证券清算款	-	-	22,791.03	22,791.03
应付交易费用	-	-	226,959.85	226,959.85
应交税费	-	-	9,191.52	9,191.52
其他负债	-	-	715,510.06	715,510.06
负债总计	-	-	1,019,021.92	1,019,021.92
利率敏感度缺口	18,487,183.27	-	-235,073,893.89	253,561,077.16

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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%。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。

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。

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。

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 2021年6月30日		上年度末 2020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	310,302,859.14	93.20	235,625,652.76	92.93
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	310,302,859.14	93.20	235,625,652.76	92.93

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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升 5%	16,436,865.30	9,735,498.51
	业绩比较基准下降 5%	-16,436,865.30	-9,735,498.51

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	310,302,859.14	93.09
	其中：股票	310,302,859.14	93.09
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	20,242,778.02	6.07
8	其他各项资产	2,782,066.91	0.83
9	合计	333,327,704.07	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2.1 的合计项不含可退替代款估值增值。

报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 5,916,490.00 元，占基金资产净值比为 1.78%。

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	2,966,681.00	0.89
B	采矿业	10,796,588.05	3.24
C	制造业	195,133,859.65	58.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,710,623.60	2.32
E	建筑业	5,597,511.00	1.68
F	批发和零售业	10,349,445.20	3.11
G	交通运输、仓储和邮政业	5,844,579.03	1.76
H	住宿和餐饮业	1,611,760.76	0.48
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,422,526.74	7.64

J	金融业	17,719,304.08	5.32
K	房地产业	10,104,629.20	3.03
L	租赁和商务服务业	3,996,623.00	1.20
M	科学研究和技术服务业	797,676.40	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	2,570,901.60	0.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	193,275.20	0.06
Q	卫生和社会工作	819,620.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	3,166,156.00	0.95
S	综合	2,664,828.00	0.80
	合计	307,466,588.51	92.35

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,429,532.27	0.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	46,404.58	0.01
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	231,492.31	0.07
J	金融业	34,721.10	0.01
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	44,438.33	0.01
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	2,836,270.63	0.85

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	002709	天赐材料	28,240	3,009,819.20	0.90
2	000799	酒鬼酒	11,200	2,862,720.00	0.86
3	603486	科沃斯	11,340	2,586,427.20	0.78
4	600089	特变电工	183,700	2,360,545.00	0.71
5	000009	中国宝安	127,500	2,329,425.00	0.70
6	002340	格林美	236,300	2,209,405.00	0.66
7	002074	国轩高科	50,700	2,208,492.00	0.66
8	600460	士兰微	38,900	2,192,015.00	0.66
9	300207	欣旺达	66,400	2,161,984.00	0.65
10	300285	国瓷材料	39,700	1,935,375.00	0.58
11	601233	桐昆股份	79,100	1,905,519.00	0.57
12	600733	北汽蓝谷	130,000	1,752,400.00	0.53
13	002185	华天科技	108,400	1,668,276.00	0.50
14	600885	宏发股份	25,800	1,617,660.00	0.49
15	300316	晶盛机电	31,800	1,605,900.00	0.48
16	601636	旗滨集团	79,600	1,477,376.00	0.44
17	300037	新宙邦	14,200	1,421,420.00	0.43
18	300146	汤臣倍健	42,000	1,381,800.00	0.42
19	601168	西部矿业	115,300	1,375,529.00	0.41
20	300253	卫宁健康	84,300	1,371,561.00	0.41
21	002648	卫星石化	34,060	1,334,811.40	0.40
22	002625	光启技术	63,900	1,329,759.00	0.40
23	002223	鱼跃医疗	34,700	1,323,111.00	0.40
24	600884	杉杉股份	56,365	1,314,431.80	0.39
25	603737	三棵树	7,440	1,309,440.00	0.39
26	000830	鲁西化工	68,500	1,283,005.00	0.39
27	002078	太阳纸业	95,900	1,280,265.00	0.38
28	600219	南山铝业	354,100	1,274,760.00	0.38
29	601127	小康股份	19,100	1,273,397.00	0.38
30	002353	杰瑞股份	28,400	1,269,480.00	0.38
31	002138	顺络电子	31,800	1,232,886.00	0.37
32	600779	水井坊	9,700	1,225,595.00	0.37

33	603589	口子窖	17,800	1,204,882.00	0.36
34	000547	航天发展	63,500	1,198,245.00	0.36
35	600704	物产中大	151,300	1,190,731.00	0.36
36	002797	第一创业	166,000	1,185,240.00	0.36
37	300699	光威复材	15,400	1,169,630.00	0.35
38	000988	华工科技	49,600	1,166,592.00	0.35
39	002212	天融信	58,500	1,156,545.00	0.35
40	688099	晶晨股份	10,300	1,155,660.00	0.35
41	002444	巨星科技	33,845	1,153,437.60	0.35
42	603893	瑞芯微	8,200	1,143,572.00	0.34
43	601099	太平洋	337,300	1,143,447.00	0.34
44	002422	科伦药业	56,400	1,125,180.00	0.34
45	002385	大北农	163,700	1,113,160.00	0.33
46	603444	吉比特	2,100	1,113,000.00	0.33
47	000807	云铝股份	92,700	1,103,130.00	0.33
48	600739	辽宁成大	52,900	1,100,849.00	0.33
49	688002	睿创微纳	10,927	1,090,842.41	0.33
50	300308	中际旭创	28,200	1,086,264.00	0.33
51	002092	中泰化学	104,800	1,076,296.00	0.32
52	601117	中国化学	122,600	1,073,976.00	0.32
53	002439	启明星辰	36,900	1,070,469.00	0.32
54	000636	风华高科	35,400	1,069,788.00	0.32
55	600862	中航高科	34,500	1,061,910.00	0.32
56	600563	法拉电子	6,700	1,061,012.00	0.32
57	600392	盛和资源	60,700	1,053,752.00	0.32
58	000825	太钢不锈	138,700	1,038,863.00	0.31
59	600699	均胜电子	40,600	1,036,112.00	0.31
60	002030	达安基因	48,496	1,030,055.04	0.31
61	600754	锦江酒店	18,074	1,029,314.30	0.31
62	600486	扬农化工	9,200	1,028,284.00	0.31
63	002180	纳思达	31,800	1,023,960.00	0.31
64	000932	华菱钢铁	155,000	1,023,000.00	0.31
65	600068	葛洲坝	136,500	1,022,385.00	0.31
66	002250	联化科技	36,500	1,018,350.00	0.31
67	600315	上海家化	16,800	1,010,352.00	0.30
68	300088	长信科技	121,400	1,002,764.00	0.30
69	600418	江淮汽车	80,500	1,000,615.00	0.30
70	002507	涪陵榨菜	26,300	990,458.00	0.30
71	000630	铜陵有色	363,900	989,808.00	0.30
72	603605	珀莱雅	5,000	983,550.00	0.30
73	002152	广电运通	75,400	982,462.00	0.30
74	600201	生物股份	55,738	972,628.10	0.29

75	002013	中航机电	95,900	965,713.00	0.29
76	000039	中集集团	52,800	959,904.00	0.29
77	002075	沙钢股份	87,300	952,443.00	0.29
78	002127	南极电商	97,100	948,667.00	0.28
79	300223	北京君正	9,300	938,556.00	0.28
80	300001	特锐德	30,900	930,399.00	0.28
81	002028	思源电气	30,100	926,779.00	0.28
82	000513	丽珠集团	18,400	920,368.00	0.28
83	600177	雅戈尔	137,400	905,466.00	0.27
84	601997	贵阳银行	126,400	905,024.00	0.27
85	002511	中顺洁柔	32,400	892,620.00	0.27
86	000021	深科技	46,300	886,182.00	0.27
87	601005	重庆钢铁	331,300	884,571.00	0.27
88	002273	水晶光电	60,100	882,869.00	0.27
89	002299	圣农发展	36,900	881,172.00	0.26
90	600549	厦门钨业	42,000	874,860.00	0.26
91	002080	中材科技	33,200	868,844.00	0.26
92	002465	海格通信	91,300	863,698.00	0.26
93	600988	赤峰黄金	57,600	863,424.00	0.26
94	000050	深天马 A	60,800	862,144.00	0.26
95	002603	以岭药业	29,500	860,220.00	0.26
96	600171	上海贝岭	28,200	858,126.00	0.26
97	300168	万达信息	58,700	857,020.00	0.26
98	000739	普洛药业	29,100	855,540.00	0.26
99	300482	万孚生物	13,200	853,908.00	0.26
100	300618	寒锐钴业	10,700	843,588.00	0.25
101	300009	安科生物	56,592	843,220.80	0.25
102	000983	山西焦煤	101,270	841,553.70	0.25
103	601128	常熟银行	135,600	840,720.00	0.25
104	600867	通化东宝	70,400	840,576.00	0.25
105	600516	方大炭素	112,700	838,488.00	0.25
106	600066	宇通客车	67,000	836,830.00	0.25
107	000998	隆平高科	52,100	835,684.00	0.25
108	600536	中国软件	14,600	831,178.00	0.25
109	600637	东方明珠	101,300	829,647.00	0.25
110	300357	我武生物	12,900	827,148.00	0.25
111	600316	洪都航空	21,300	819,624.00	0.25
112	300244	迪安诊断	21,400	819,620.00	0.25
113	600707	彩虹股份	86,900	817,729.00	0.25
114	601689	拓普集团	21,800	815,974.00	0.25
115	300463	迈克生物	19,200	808,128.00	0.24
116	600879	航天电子	107,400	807,648.00	0.24

117	600369	西南证券	164,500	801,115.00	0.24
118	600827	百联股份	39,700	799,955.00	0.24
119	000723	美锦能源	105,800	799,848.00	0.24
120	300070	碧水源	109,400	799,714.00	0.24
121	600487	亨通光电	70,000	798,000.00	0.24
122	000750	国海证券	188,200	797,968.00	0.24
123	600529	山东药玻	23,500	797,825.00	0.24
124	600380	健康元	58,100	797,713.00	0.24
125	000027	深圳能源	86,480	793,021.60	0.24
126	000960	锡业股份	49,400	791,882.00	0.24
127	002156	通富微电	32,900	790,916.00	0.24
128	300271	华宇软件	40,900	787,325.00	0.24
129	600166	福田汽车	227,700	785,565.00	0.24
130	300296	利亚德	100,400	785,128.00	0.24
131	000975	银泰黄金	82,260	782,292.60	0.23
132	002373	千方科技	46,800	781,560.00	0.23
133	002131	利欧股份	333,600	780,624.00	0.23
134	601615	明阳智能	48,200	780,358.00	0.23
135	600909	华安证券	139,440	776,680.80	0.23
136	688208	道通科技	8,900	774,211.00	0.23
137	600038	中直股份	14,600	770,004.00	0.23
138	300383	光环新网	53,500	769,865.00	0.23
139	603290	斯达半导	2,400	768,000.00	0.23
140	002572	索菲亚	31,600	764,720.00	0.23
141	000718	苏宁环球	92,000	762,680.00	0.23
142	002926	华西证券	77,900	750,177.00	0.23
143	600642	申能股份	121,600	746,624.00	0.22
144	601198	东兴证券	68,100	744,333.00	0.22
145	002690	美亚光电	13,300	741,608.00	0.22
146	601866	中远海发	196,400	736,500.00	0.22
147	300115	长盈精密	35,680	735,008.00	0.22
148	002065	东华软件	92,500	733,525.00	0.22
149	300474	景嘉微	7,400	724,608.00	0.22
150	002294	信立泰	22,000	723,800.00	0.22
151	002408	齐翔腾达	57,700	716,634.00	0.22
152	600271	航天信息	54,900	715,347.00	0.21
153	603156	养元饮品	25,000	714,500.00	0.21
154	000623	吉林敖东	46,100	714,089.00	0.21
155	002500	山西证券	106,420	714,078.20	0.21
156	603638	艾迪精密	16,580	710,784.60	0.21
157	601016	节能风电	190,000	710,600.00	0.21
158	600998	九州通	46,200	710,094.00	0.21

159	600415	小商品城	135,600	698,340.00	0.21
160	601699	潞安环能	59,100	697,971.00	0.21
161	600895	张江高科	38,200	697,914.00	0.21
162	000012	南玻A	67,700	693,248.00	0.21
163	600153	建发股份	84,700	686,070.00	0.21
164	600188	兖州煤业	44,100	677,376.00	0.20
165	300630	普利制药	12,901	676,012.40	0.20
166	600256	广汇能源	200,600	667,998.00	0.20
167	600390	五矿资本	111,000	663,780.00	0.20
168	600535	天士力	44,800	663,488.00	0.20
169	300418	昆仑万维	40,500	663,390.00	0.20
170	600667	太极实业	72,800	662,480.00	0.20
171	000158	常山北明	57,400	659,526.00	0.20
172	300024	机器人	61,700	658,339.00	0.20
173	600060	海信视像	38,900	657,410.00	0.20
174	600008	首创环保	217,500	654,675.00	0.20
175	002670	国盛金控	57,400	653,786.00	0.20
176	002372	伟星新材	31,500	651,105.00	0.20
177	600497	驰宏锌锗	151,000	650,810.00	0.20
178	002557	洽洽食品	15,000	646,500.00	0.19
179	002382	蓝帆医疗	31,000	646,350.00	0.19
180	600208	新潮中宝	212,400	645,696.00	0.19
181	000878	云南铜业	50,300	645,349.00	0.19
182	600155	华创阳安	60,301	645,220.70	0.19
183	603858	步长制药	28,200	634,218.00	0.19
184	002019	亿帆医药	36,700	633,075.00	0.19
185	600765	中航重机	27,900	631,935.00	0.19
186	600372	中航电子	38,100	630,555.00	0.19
187	300182	捷成股份	126,000	628,740.00	0.19
188	300251	光线传媒	57,900	625,899.00	0.19
189	600141	兴发集团	33,200	625,156.00	0.19
190	600498	烽火通信	33,500	624,105.00	0.19
191	688029	南微医学	2,000	623,380.00	0.19
192	002221	东华能源	56,900	623,055.00	0.19
193	002174	游族网络	36,200	621,554.00	0.19
194	600511	国药股份	18,700	618,222.00	0.19
195	600409	三友化工	61,100	617,721.00	0.19
196	002683	宏大爆破	22,200	616,494.00	0.19
197	000488	晨鸣纸业	74,700	608,058.00	0.18
198	600170	上海建工	220,200	607,752.00	0.18
199	002966	苏州银行	82,600	607,110.00	0.18
200	002146	荣盛发展	107,500	606,300.00	0.18

201	002390	信邦制药	57,800	605,744.00	0.18
202	002506	协鑫集成	173,600	604,128.00	0.18
203	000401	冀东水泥	48,900	603,915.00	0.18
204	000997	新大陆	36,400	603,876.00	0.18
205	600875	东方电气	54,900	602,253.00	0.18
206	601717	郑煤机	51,600	600,108.00	0.18
207	002004	华邦健康	96,400	598,644.00	0.18
208	300058	蓝色光标	98,600	596,530.00	0.18
209	600801	华新水泥	33,700	592,109.00	0.18
210	000738	航发控制	28,300	589,489.00	0.18
211	600160	巨化股份	66,600	588,744.00	0.18
212	002958	青农商行	137,500	588,500.00	0.18
213	603866	桃李面包	18,800	586,560.00	0.18
214	000686	东北证券	69,400	586,430.00	0.18
215	600258	首旅酒店	24,411	582,446.46	0.17
216	603707	健友股份	13,900	580,325.00	0.17
217	300315	掌趣科技	136,100	578,425.00	0.17
218	600663	陆家嘴	43,400	578,088.00	0.17
219	002195	二三四五	283,600	575,708.00	0.17
220	002268	卫士通	29,300	570,764.00	0.17
221	002002	鸿达兴业	145,100	570,243.00	0.17
222	603260	合盛硅业	7,400	569,134.00	0.17
223	688088	虹软科技	10,200	568,650.00	0.17
224	000540	中天金融	207,500	566,475.00	0.17
225	300017	网宿科技	96,700	565,695.00	0.17
226	600325	华发股份	83,700	564,138.00	0.17
227	688321	微芯生物	12,200	563,518.00	0.17
228	603225	新凤鸣	27,700	562,310.00	0.17
229	600732	爱旭股份	40,200	559,584.00	0.17
230	000060	中金岭南	123,500	558,220.00	0.17
231	601992	金隅集团	206,600	555,754.00	0.17
232	600859	王府井	19,200	554,496.00	0.17
233	600027	华电国际	161,000	553,840.00	0.17
234	603712	七一二	15,309	552,654.90	0.17
235	000961	中南建设	93,300	552,336.00	0.17
236	600567	山鹰国际	159,900	551,655.00	0.17
237	002831	裕同科技	18,500	549,265.00	0.16
238	603077	和邦生物	262,500	546,000.00	0.16
239	000883	湖北能源	118,300	542,997.00	0.16
240	002429	兆驰股份	89,400	542,658.00	0.16
241	600282	南钢股份	152,200	541,832.00	0.16
242	603927	中科软	12,600	541,170.00	0.16

243	002191	劲嘉股份	50,600	538,384.00	0.16
244	600500	中化国际	68,300	536,838.00	0.16
245	603883	老百姓	10,140	534,175.20	0.16
246	601577	长沙银行	59,700	533,718.00	0.16
247	600216	浙江医药	33,300	533,133.00	0.16
248	600528	中铁工业	65,800	532,980.00	0.16
249	300212	易华录	19,800	532,818.00	0.16
250	000671	阳光城	102,100	530,920.00	0.16
251	600839	四川长虹	182,000	529,620.00	0.16
252	600737	中粮糖业	52,900	529,529.00	0.16
253	002595	豪迈科技	19,800	528,660.00	0.16
254	000898	鞍钢股份	118,500	527,325.00	0.16
255	603198	迎驾贡酒	11,900	527,170.00	0.16
256	002056	横店东磁	40,500	526,500.00	0.16
257	002081	金螳螂	66,300	525,096.00	0.16
258	600598	北大荒	35,100	525,096.00	0.16
259	000709	河钢股份	210,300	517,338.00	0.16
260	000581	威孚高科	24,800	516,584.00	0.16
261	000999	华润三九	19,300	516,275.00	0.16
262	002203	海亮股份	48,500	516,040.00	0.15
263	600580	卧龙电驱	38,700	514,710.00	0.15
264	600410	华胜天成	66,300	514,488.00	0.15
265	600728	佳都科技	69,400	514,254.00	0.15
266	002124	天邦股份	73,320	513,973.20	0.15
267	002281	光迅科技	20,700	509,220.00	0.15
268	600808	马钢股份	117,800	505,362.00	0.15
269	600126	杭钢股份	98,400	504,792.00	0.15
270	002010	传化智联	65,400	504,234.00	0.15
271	000729	燕京啤酒	69,500	503,180.00	0.15
272	000930	中粮科技	55,200	497,352.00	0.15
273	300166	东方国信	40,100	495,636.00	0.15
274	002242	九阳股份	15,200	493,848.00	0.15
275	002396	星网锐捷	23,100	493,185.00	0.15
276	600820	隧道股份	93,200	493,028.00	0.15
277	002387	维信诺	47,200	492,296.00	0.15
278	002745	木林森	36,600	490,440.00	0.15
279	000402	金融街	72,200	487,350.00	0.15
280	000629	攀钢钒钛	212,500	486,625.00	0.15
281	002048	宁波华翔	24,800	483,600.00	0.15
282	002563	森马服饰	40,100	479,195.00	0.14
283	600755	厦门国贸	57,900	475,359.00	0.14
284	600970	中材国际	51,700	474,089.00	0.14

285	300002	神州泰岳	97,100	470,935.00	0.14
286	603000	人民网	27,200	467,568.00	0.14
287	600022	山东钢铁	271,000	466,120.00	0.14
288	600803	新奥股份	28,200	465,582.00	0.14
289	600398	海澜之家	64,200	464,808.00	0.14
290	000959	首钢股份	82,700	464,774.00	0.14
291	000598	兴蓉环境	88,800	462,648.00	0.14
292	600037	歌华有线	48,100	462,241.00	0.14
293	601106	中国一重	135,700	460,023.00	0.14
294	600881	亚泰集团	160,300	456,855.00	0.14
295	600307	酒钢宏兴	195,500	453,560.00	0.14
296	002925	盈趣科技	11,600	451,356.00	0.14
297	600811	东方集团	147,000	448,350.00	0.13
298	600039	四川路桥	70,900	444,543.00	0.13
299	603885	吉祥航空	29,100	444,066.00	0.13
300	601880	辽港股份	258,700	442,377.00	0.13
301	601456	国联证券	28,700	441,980.00	0.13
302	600348	华阳股份	59,500	441,490.00	0.13
303	000778	新兴铸管	118,400	440,448.00	0.13
304	000690	宝新能源	85,900	438,949.00	0.13
305	000887	中鼎股份	36,300	438,504.00	0.13
306	600143	金发科技	21,000	438,060.00	0.13
307	600782	新钢股份	78,500	438,030.00	0.13
308	600260	凯乐科技	49,300	437,784.00	0.13
309	600597	光明乳业	30,300	436,623.00	0.13
310	601118	海南橡胶	84,600	430,614.00	0.13
311	002705	新宝股份	16,400	430,500.00	0.13
312	002701	奥瑞金	83,700	430,218.00	0.13
313	600435	北方导航	54,100	429,554.00	0.13
314	002867	周大生	21,700	429,009.00	0.13
315	002249	大洋电机	81,700	428,925.00	0.13
316	603568	伟明环保	18,720	427,377.60	0.13
317	600967	内蒙一机	42,200	427,064.00	0.13
318	600908	无锡银行	73,600	426,880.00	0.13
319	002085	万丰奥威	75,800	424,480.00	0.13
320	600645	中源协和	18,472	423,932.40	0.13
321	600026	中远海能	68,400	421,344.00	0.13
322	600804	鹏博士	86,900	420,596.00	0.13
323	600718	东软集团	43,000	420,540.00	0.13
324	002183	怡亚通	73,200	419,436.00	0.13
325	603650	彤程新材	8,700	418,470.00	0.13
326	601179	中国西电	101,400	417,768.00	0.13

327	000528	柳工	50,900	417,380.00	0.13
328	600985	淮北矿业	33,900	413,919.00	0.12
329	600572	康恩贝	92,000	408,480.00	0.12
330	002110	三钢闽光	60,500	407,770.00	0.12
331	000877	天山股份	31,100	405,233.00	0.12
332	600446	金证股份	28,000	404,320.00	0.12
333	600167	联美控股	45,200	403,636.00	0.12
334	000970	中科三环	42,200	403,010.00	0.12
335	002368	太极股份	20,079	402,784.74	0.12
336	300072	三聚环保	69,800	400,652.00	0.12
337	002266	浙富控股	79,800	398,202.00	0.12
338	600064	南京高科	42,800	397,612.00	0.12
339	601200	上海环境	33,200	397,404.00	0.12
340	002128	露天煤业	38,100	396,621.00	0.12
341	600329	中新药业	14,100	396,069.00	0.12
342	000990	诚志股份	31,100	395,903.00	0.12
343	000089	深圳机场	50,800	394,716.00	0.12
344	601598	中国外运	77,900	393,395.00	0.12
345	600517	国网英大	56,600	385,446.00	0.12
346	600158	中体产业	33,300	379,953.00	0.11
347	000400	许继电气	29,900	378,534.00	0.11
348	300026	红日药业	88,800	377,400.00	0.11
349	003035	南网能源	37,600	373,744.00	0.11
350	000519	中兵红箭	34,500	369,840.00	0.11
351	300376	易事特	45,900	369,036.00	0.11
352	601718	际华集团	130,500	368,010.00	0.11
353	600120	浙江东方	85,856	367,463.68	0.11
354	601975	招商南油	170,400	364,656.00	0.11
355	002985	北摩高科	3,740	364,650.00	0.11
356	002233	塔牌集团	35,300	362,884.00	0.11
357	600507	方大特钢	53,471	362,533.38	0.11
358	600195	中牧股份	30,180	360,952.80	0.11
359	001914	招商积余	21,000	360,780.00	0.11
360	600376	首开股份	63,800	357,280.00	0.11
361	601333	广深铁路	168,300	356,796.00	0.11
362	000685	中山公用	43,700	356,592.00	0.11
363	000090	天健集团	64,400	356,132.00	0.11
364	002505	鹏都农牧	158,000	353,920.00	0.11
365	601000	唐山港	146,400	352,824.00	0.11
366	002440	闰土股份	39,800	352,230.00	0.11
367	000559	万向钱潮	65,100	345,681.00	0.10
368	002839	张家港行	62,700	341,088.00	0.10

369	600643	爱建集团	48,200	336,436.00	0.10
370	600673	东阳光	74,700	335,403.00	0.10
371	603228	景旺电子	12,720	333,264.00	0.10
372	300133	华策影视	56,200	332,704.00	0.10
373	600373	中文传媒	33,500	330,310.00	0.10
374	601860	紫金银行	90,600	328,878.00	0.10
375	601991	大唐发电	122,900	324,456.00	0.10
376	000758	中色股份	68,200	323,950.00	0.10
377	002155	湖南黄金	41,553	322,035.75	0.10
378	601608	中信重工	86,100	322,014.00	0.10
379	002038	双鹭药业	30,500	321,165.00	0.10
380	000967	盈峰环境	46,700	320,829.00	0.10
381	600056	中国医药	26,400	320,760.00	0.10
382	600582	天地科技	81,700	318,630.00	0.10
383	002936	郑州银行	86,510	317,491.70	0.10
384	600266	城建发展	66,780	316,537.20	0.10
385	600388	龙净环保	37,000	315,240.00	0.09
386	000563	陕国投 A	97,800	314,916.00	0.09
387	601098	中南传媒	35,700	314,874.00	0.09
388	000681	视觉中国	24,300	314,199.00	0.09
389	300113	顺网科技	24,100	311,854.00	0.09
390	600131	国网信通	23,500	311,140.00	0.09
391	601958	金钼股份	47,800	309,744.00	0.09
392	300741	华宝股份	6,100	309,392.00	0.09
393	600095	湘财股份	26,400	309,144.00	0.09
394	600928	西安银行	66,100	308,026.00	0.09
395	600901	江苏租赁	59,200	307,840.00	0.09
396	600062	华润双鹤	25,700	306,087.00	0.09
397	002416	爱施德	30,500	305,915.00	0.09
398	600259	广晟有色	9,000	304,290.00	0.09
399	003022	联泓新科	9,900	303,930.00	0.09
400	300180	华峰超纤	60,800	300,960.00	0.09
401	600959	江苏有线	98,600	300,730.00	0.09
402	600649	城投控股	62,800	298,928.00	0.09
403	600094	大名城	78,900	297,453.00	0.09
404	600764	中国海防	10,500	297,150.00	0.09
405	000415	渤海租赁	121,800	294,756.00	0.09
406	002399	海普瑞	18,500	294,705.00	0.09
407	002458	益生股份	29,500	294,115.00	0.09
408	600776	东方通信	23,700	293,880.00	0.09
409	600006	东风汽车	39,500	288,350.00	0.09
410	600556	天下秀	26,900	284,064.00	0.09

411	601611	中国核建	39,300	283,746.00	0.09
412	600546	山煤国际	39,300	282,174.00	0.08
413	300257	开山股份	19,600	281,652.00	0.08
414	000028	国药一致	7,400	280,016.00	0.08
415	600717	天津港	71,424	279,982.08	0.08
416	002317	众生药业	32,200	277,242.00	0.08
417	600633	浙数文化	38,500	276,430.00	0.08
418	600729	重庆百货	10,000	274,500.00	0.08
419	600648	外高桥	18,500	273,430.00	0.08
420	000717	韶钢松山	59,500	273,105.00	0.08
421	601928	凤凰传媒	37,600	268,464.00	0.08
422	002434	万里扬	33,000	267,630.00	0.08
423	000501	鄂武商 A	22,800	266,760.00	0.08
424	600021	上海电力	38,600	266,726.00	0.08
425	600863	内蒙华电	114,300	266,319.00	0.08
426	000078	海王生物	81,600	266,016.00	0.08
427	000062	深圳华强	15,600	263,796.00	0.08
428	002375	亚厦股份	33,200	262,944.00	0.08
429	601828	美凯龙	21,800	261,600.00	0.08
430	600968	海油发展	100,900	261,331.00	0.08
431	002244	滨江集团	61,700	258,523.00	0.08
432	600835	上海机电	15,900	258,375.00	0.08
433	002424	贵州百灵	34,700	255,392.00	0.08
434	605358	立昂微	2,200	254,276.00	0.08
435	603355	莱克电气	4,000	248,920.00	0.07
436	000869	张裕 A	6,700	248,838.00	0.07
437	600623	华谊集团	27,800	244,918.00	0.07
438	600377	宁沪高速	24,500	239,120.00	0.07
439	600566	济川药业	13,200	236,280.00	0.07
440	600312	平高电气	40,300	235,352.00	0.07
441	300010	豆神教育	41,400	234,738.00	0.07
442	600339	中油工程	82,600	234,584.00	0.07
443	600787	中储股份	43,500	231,855.00	0.07
444	002468	申通快递	30,300	230,886.00	0.07
445	000031	大悦城	63,600	228,960.00	0.07
446	600639	浦东金桥	16,700	227,955.00	0.07
447	002583	海能达	45,200	227,808.00	0.07
448	000826	启迪环境	42,500	227,375.00	0.07
449	600823	世茂股份	55,600	224,624.00	0.07
450	601969	海南矿业	19,300	224,459.00	0.07
451	601778	晶科科技	40,900	223,314.00	0.07
452	600466	蓝光发展	75,200	221,840.00	0.07

453	603317	天味食品	7,494	220,548.42	0.07
454	603888	新华网	10,300	218,051.00	0.07
455	002815	崇达技术	17,200	214,656.00	0.06
456	601298	青岛港	34,600	213,828.00	0.06
457	002532	天山铝业	25,300	212,267.00	0.06
458	000156	华数传媒	27,400	211,254.00	0.06
459	603708	家家悦	12,000	208,440.00	0.06
460	000937	冀中能源	52,600	206,718.00	0.06
461	002948	青岛银行	40,800	202,776.00	0.06
462	002635	安洁科技	13,800	201,894.00	0.06
463	000553	安道麦 A	21,600	200,232.00	0.06
464	000813	德展健康	44,000	199,760.00	0.06
465	002302	西部建设	25,000	197,500.00	0.06
466	601228	广州港	61,500	195,570.00	0.06
467	603377	东方时尚	18,080	193,275.20	0.06
468	600640	号百控股	15,800	192,602.00	0.06
469	603515	欧普照明	7,500	192,525.00	0.06
470	600350	山东高速	31,000	190,650.00	0.06
471	001872	招商港口	11,100	187,812.00	0.06
472	601139	深圳燃气	28,600	187,616.00	0.06
473	600871	石化油服	93,400	183,998.00	0.06
474	000061	农产品	33,300	183,816.00	0.06
475	000046	泛海控股	76,800	176,640.00	0.05
476	002653	海思科	8,000	172,160.00	0.05
477	603056	德邦股份	15,305	168,201.95	0.05
478	601568	北元集团	19,600	167,776.00	0.05
479	603379	三美股份	8,940	167,267.40	0.05
480	603786	科博达	2,200	166,100.00	0.05
481	002901	大博医疗	2,200	160,358.00	0.05
482	002419	天虹股份	23,700	155,472.00	0.05
483	601003	柳钢股份	25,400	149,860.00	0.05
484	601512	中新集团	14,700	146,412.00	0.04
485	601869	长飞光纤	6,000	146,160.00	0.04
486	600657	信达地产	41,900	145,812.00	0.04
487	000537	广宇发展	27,700	144,871.00	0.04
488	601801	皖新传媒	29,600	139,712.00	0.04
489	603983	丸美股份	2,600	135,486.00	0.04
490	601187	厦门银行	14,200	134,616.00	0.04
491	002946	新乳业	8,500	128,775.00	0.04
492	600917	重庆燃气	15,700	128,269.00	0.04
493	603719	良品铺子	2,800	126,000.00	0.04
494	000732	泰禾集团	48,700	105,192.00	0.03

495	600903	贵州燃气	11,300	103,960.00	0.03
496	603868	飞科电器	2,400	100,944.00	0.03
497	002818	富森美	7,400	89,244.00	0.03
498	002423	中粮资本	9,100	82,355.00	0.02
499	600956	新天绿能	6,900	80,799.00	0.02
500	603256	宏和科技	8,700	79,518.00	0.02
501	601068	中铝国际	15,600	53,820.00	0.02

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	688617	惠泰医疗	1,070	399,366.80	0.12
2	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.08
3	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.07
4	688059	华锐精密	1,023	163,945.98	0.05
5	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.05
6	688079	美迪凯	6,897	126,904.80	0.04
7	688578	艾力斯-U	3,652	120,406.44	0.04
8	688201	信安世纪	2,129	96,677.89	0.03
9	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.02
10	688316	青云科技-U	1,142	74,230.00	0.02
11	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
12	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.02
13	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
14	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
15	688260	昀冢科技	2,990	49,065.90	0.01
16	300957	贝泰妮	190	47,872.40	0.01
17	300919	中伟股份	275	44,825.00	0.01
18	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
19	300894	火星人	591	40,188.00	0.01
20	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
21	300979	华利集团	343	30,012.50	0.01
22	300973	立高食品	255	29,506.05	0.01
23	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
24	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
25	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
26	300981	中红医疗	228	20,608.92	0.01
27	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
28	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
29	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
30	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
31	300941	创识科技	287	14,332.78	0.00

32	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
33	300932	三友联众	438	13,888.98	0.00
34	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
35	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
36	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
37	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
38	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
39	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
40	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
41	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
42	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
43	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
44	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
45	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
46	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
47	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
48	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
49	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
50	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
51	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
52	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
53	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
54	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
55	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
56	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
57	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
58	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
59	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
60	300985	致远新能	283	7,021.23	0.00
61	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
62	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
63	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
64	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
65	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
66	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
67	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
68	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
69	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
70	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
71	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
72	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
73	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
74	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00

75	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
76	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
77	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	000799	酒鬼酒	2,576,177.00	1.02
2	601636	旗滨集团	1,454,371.00	0.57
3	300253	卫宁健康	1,332,314.00	0.53
4	300037	新宙邦	1,281,494.00	0.51
5	002439	启明星辰	1,105,618.00	0.44
6	002422	科伦药业	1,076,029.00	0.42
7	600177	雅戈尔	1,056,910.00	0.42
8	300308	中际旭创	1,033,835.00	0.41
9	601233	桐昆股份	995,887.00	0.39
10	600068	葛洲坝	982,375.00	0.39
11	600536	中国软件	979,864.00	0.39
12	600988	赤峰黄金	972,383.00	0.38
13	600089	特变电工	966,912.70	0.38
14	603737	三棵树	939,383.40	0.37
15	603345	安井食品	936,643.00	0.37
16	600637	东方明珠	917,051.17	0.36
17	600066	宇通客车	902,153.00	0.36
18	600369	西南证券	870,544.00	0.34
19	601168	西部矿业	867,641.00	0.34
20	600487	亨通光电	863,929.00	0.34

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	300274	阳光电源	4,471,499.00	1.76
2	600426	华鲁恒升	2,842,815.60	1.12
3	300012	华测检测	2,448,219.54	0.97
4	600132	重庆啤酒	2,268,736.00	0.89
5	603882	金域医学	2,230,757.00	0.88
6	300496	中科创达	2,126,717.00	0.84
7	300595	欧普康视	2,069,353.00	0.82
8	603345	安井食品	1,946,452.00	0.77
9	601799	星宇股份	1,916,086.00	0.76

10	603806	福斯特	1,828,512.96	0.72
11	601966	玲珑轮胎	1,760,987.20	0.69
12	600143	金发科技	1,749,260.00	0.69
13	600079	人福医药	1,728,182.00	0.68
14	603816	顾家家居	1,447,931.00	0.57
15	002568	百润股份	1,393,870.80	0.55
16	002791	坚朗五金	1,119,159.00	0.44
17	002064	华峰化学	825,842.00	0.33
18	002920	德赛西威	805,314.00	0.32
19	000301	东方盛虹	795,918.00	0.31
20	603338	浙江鼎力	783,580.00	0.31

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	133,083,359.98
卖出股票收入（成交）总额	102,081,796.77

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IC2109	IC2109	12	16,000,800.00	535,560.00	-
公允价值变动总额合计（元）					535,560.00
股指期货投资本期收益（元）					1,497,980.58

股指期货投资本期公允价值变动（元）	370,440.00
-------------------	------------

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。

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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库

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	2,292,595.79
2	应收证券清算款	481,882.83
3	应收股利	2,608.66
4	应收利息	4,979.63
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	2,782,066.91

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

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	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600460	士兰微	2,192,015.00	0.66	重大事项

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	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688617	惠泰医疗	399,366.80	0.12	锁定期股票
2	688690	纳微科技	277,777.53	0.08	锁定期股票
3	688665	四方光电	218,399.02	0.07	锁定期股票
4	688059	华锐精密	163,945.98	0.05	锁定期股票
5	688609	九联科技	158,587.88	0.05	锁定期股票

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

8.1.1 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 (%)
10,258	21,467.27	80,111,823.00	36.38	140,099,430.00	63.62

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国工商银行股份有限公司	41,823,836.00	18.99

-鹏华中证 500 交易型开放式 指数证券投资基金联接基金		
----------------------------------	--	--

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	鹏华基金—明珠理财 月月赢系列 2020 年第 11 期—鹏华基金连赢 量化 FOF1 号单一资产 管理计划	20,674,049.00	9.39
2	方正证券股份有限公司	4,631,333.00	2.10
3	北京磐沣投资管理合 伙企业（有限合伙）— 磐沣固收增强私募证 券投资基金	4,211,600.00	1.91
4	招商证券股份有限公司	3,508,371.00	1.59
5	中信建投证券股份有 限公司	2,968,440.00	1.35
6	魏丽君	2,288,300.00	1.04
7	王雪有	2,000,000.00	0.91
8	王瑜珍	1,550,000.00	0.70
9	王永辉	1,469,600.00	0.67
10	韩肖敏	1,001,900.00	0.45
-	中国工商银行股份有 限公司—鹏华中证 500 交易型开放式指数证 券投资基金联接基金	41,823,836.00	18.99

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

注：截止本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

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

基金合同生效日（2019 年 11 月 21 日） 基金份额总额	490,211,253.00
本报告期期初基金份额总额	188,211,253.00

本报告期基金总申购份额	82,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	50,000,000.00
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	220,211,253.00

§ 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：

报告期内，公司原副总经理高阳先生辞去公司副总经理职务，经公司董事会审议通过，于 2021 年 1 月 16 日离任。

报告期内，经公司董事会审议通过，聘任王宗合先生担任公司副总经理，任职日期自 2021 年 1 月 28 日起；聘任梁浩先生担任公司副总经理，任职日期自 2021 年 1 月 28 日起。

本公司已将上述变更事项报相关监管部门备案。

报告期内，经公司股东会审议通过，史际春先生不再担任公司独立董事，于 2021 年 4 月 22 日离任；聘任蒋毅刚先生担任公司独立董事，任职日期自 2021 年 4 月 22 日起。

基金托管人的重大人事变动：

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

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

无。

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	
中金公司	1	84,888,841.96	37.19%	77,360.86	37.23%	-
国信证券	2	72,523,390.88	31.77%	66,090.73	31.81%	-
中泰证券	1	50,596,069.92	22.17%	46,108.19	22.19%	-
平安证券	1	16,013,784.05	7.02%	14,593.38	7.02%	-
国盛证券	1	2,271,430.87	1.00%	1,842.87	0.89%	-
西部证券	2	1,967,333.16	0.86%	1,792.87	0.86%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

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东莞农村商业银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月04日
2	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和网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月04日
3	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月16日
4	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月22日
5	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月28日
6	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年01月28日
7	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021年02月06日
8	鹏华基金管理有限公司关于终止包商	《中国证券报》、基金管	2021年02月08日

	银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
9	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购贝泰妮首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 19 日
10	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 26 日
11	鹏华基金管理有限公司关于修改旗下 44 只证券投资基金基金合同部分条款的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 26 日
12	鹏华基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 30 日
13	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 30 日
14	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 31 日
15	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（2021 年第 1 号）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 31 日
16	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 10 日
17	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 21 日
18	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 21 日
19	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购瑞华泰首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 23 日
20	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购志特新材首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 23 日
21	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 26 日
22	关于鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 12 日

23	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 06 月 04 日
24	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 06 月 18 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210101~20210301, 20210319~20210321, 20210609~20210615	56,345,736.00	52,003,836.00	66,525,736.00	41,823,836.00	18.99
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额和红利再投；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

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 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

（二）《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

(三)《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告》(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。

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

2021 年 8 月 30 日