

鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF） 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	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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
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	13
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	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	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61

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	61
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	61
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	61
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	61
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息.....	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末上市基金前十名持有人	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	64
§ 9 开放式基金份额变动.....	64
§ 10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§ 12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 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 500LOF	
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	232,671,292.51 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）	鹏华中证 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	179,816,745.87 份	52,854,546.64 份

注：无。

2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资方式，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以实现了对中证 500 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法，原则上按照成份股在中证 500 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性

	不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益品种。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张戈
	联系电话	0755-82825720
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn
客户服务电话	4006788999	95588
传真	0755-82021126	010-66105798
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)	
	鹏华中证 500 指数 A 类（LOF）	鹏华中证 500 指数 C 类（LOF）

本期已实现收益	35,293,928.36	3,493,409.49
本期利润	29,482,035.42	5,107,207.18
加权平均基金份额本期利润	0.1704	0.2684
本期加权平均净值利润率	10.27%	15.35%
本期基金份额净值增长率	10.22%	10.11%
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	140,047,322.65	29,033,932.31
期末可供分配基金份额利润	0.7788	0.5493
期末基金资产净值	319,864,068.52	98,996,989.79
期末基金份额净值	1.779	1.873
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	77.90%	87.30%

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

鹏华中证 500 指数 A 类（LOF）

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	2.42%	0.69%	1.12%	0.69%	1.30%	0.00%
过去三个月	11.19%	0.64%	8.42%	0.65%	2.77%	-0.01%
过去六个月	10.22%	0.95%	6.62%	0.94%	3.60%	0.01%
过去一年	28.73%	1.21%	15.38%	1.19%	13.35%	0.02%
过去三年	56.60%	1.41%	29.39%	1.40%	27.21%	0.01%
自基金合同生效起 至今	77.90%	1.61%	54.55%	1.57%	23.35%	0.04%

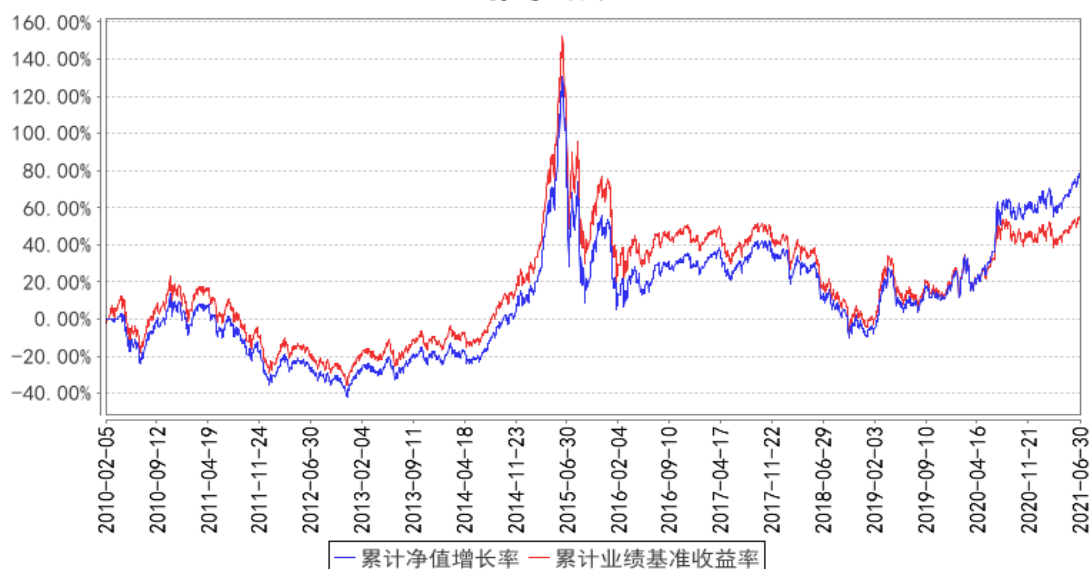
鹏华中证 500 指数 C 类（LOF）

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	2.41%	0.69%	1.12%	0.69%	1.29%	0.00%
过去三个月	11.16%	0.64%	8.42%	0.65%	2.74%	-0.01%
过去六个月	10.11%	0.95%	6.62%	0.94%	3.49%	0.01%
过去一年	28.38%	1.21%	15.38%	1.19%	13.00%	0.02%
自基金合同生效起 至今	87.30%	1.39%	52.85%	1.39%	34.45%	0.00%

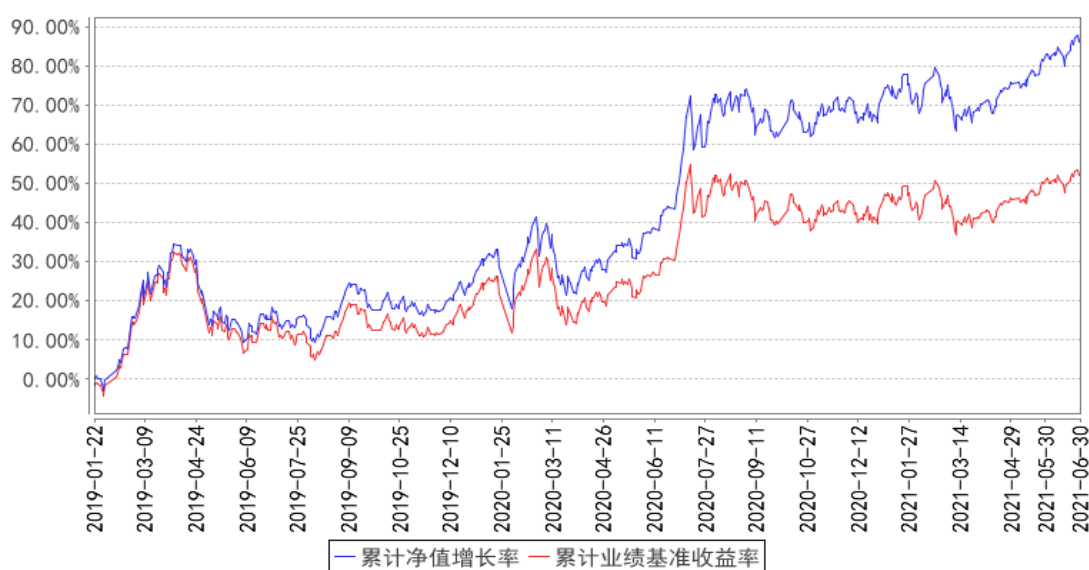
注：业绩比较基准=中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%

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



鹏华中证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		
张羽翔	基金经理	2016-09-24	-	14 年	张羽翔先生，国籍中国，工学硕士，14 年证券从业经验。曾任招商银行软件中心(原深圳市融博技术公司)数据分析师；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 月至 2020 年 06 月担任鹏华上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2015 年 09 月至 2020 年 06 月担任上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2016 年 06 月至 2018 年 05 月担任鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金经理, 2016 年 07 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理, 2016 年 09 月至今担任鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2016 年 09 月至今担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2016 年 11 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理, 2016 年 11 月至 2020 年 07 月担任鹏华中证新能源指数分级证券投资基金基金经理, 2018 年 04 月至 2020 年 12 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, 2018 年 04 月至 2020 年 12 月担任鹏华创业板指数分级证券投资基金基金经理, 2018 年 05 月至 2018 年 08 月担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理, 2018 年 05 月至今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, 2018 年 05 月至 2020 年 12 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, 2019 年 04 月至今担任鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2019 年 07 月至今担任鹏华中证国防交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2019 年 11 月至今担任鹏华港股通中证香港银行投资指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2019 年 12 月至今担任鹏华中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2020 年 02 月至今担任鹏华中证 800 证券保险交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2020 年 03 月至今担任鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华中证高铁产业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银行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酒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传媒指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华中证移动互联网指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华创业板指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金 (LOF) 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。

4.1.3 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

截至本报告期末，本报告期 A 类份额净值增长率为 10.22%，同期业绩比较基准增长率为 6.62%，C 类份额净值增长率为 10.11%，同期业绩比较基准增长率为 6.62%。

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 年下半年的经济大体维持平稳，流动性环境保持合理宽松。在全球经济缓慢修复的背景下，股债整体维持震荡的概率较大，疫情走势依旧时最大的不确定性因素，建议紧密跟踪疫情变化，上半年政策组合是“货币稳+财政紧+监管严+地产压”，下半年可能“货币预调+财政温和+监管严厉”，投资领域新旧动能转换比较明显，投资机会的呈现结构性分化，投资者需关注政策友好及盈利持续改善的行业。

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,本基金鹏华中证 500 指数 A 类(LOF)期末可供分配利润为 140,047,322.65 元,期末基金份额净值 1.779 元;鹏华中证 500 指数 C 类(LOF)期末可供分配利润为 29,033,932.31 元,期末基金份额净值 1.873 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,中国工商银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的

基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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：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	27,316,124.26	18,947,966.32
结算备付金		386,012.82	8,192.44
存出保证金		47,702.28	45,962.34
交易性金融资产	6.4.7.2	396,165,865.50	306,360,774.49
其中：股票投资		396,165,865.50	306,360,774.49
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		-	672,305.22
应收利息	6.4.7.5	2,356.93	1,818.19
应收股利		-	-
应收申购款		2,419,588.10	644,052.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		426,337,649.89	326,681,071.49
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		2,793,151.60	-
应付赎回款		3,956,963.03	3,330,549.74
应付管理人报酬		213,747.10	203,461.55
应付托管费		42,749.44	40,692.33
应付销售服务费		5,708.58	6,306.87
应付交易费用	6.4.7.7	295,965.51	149,351.42
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	168,306.32	284,859.36
负债合计		7,476,591.58	4,015,221.27
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	232,671,292.51	198,691,003.01
未分配利润	6.4.7.10	186,189,765.80	123,974,847.21
所有者权益合计		418,861,058.31	322,665,850.22
负债和所有者权益总计		426,337,649.89	326,681,071.49

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额为 232,671,292.51 份，其中鹏华中证 500 指数 A 类（LOF）基金份额总额为 179,816,745.87 份，基金份额净值 1.779 元；鹏华中证 500 指数 C 类（LOF）基金份额总额为 52,854,546.64 份，基金份额净值 1.873 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：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 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
一、收入		36,970,528.16	49,078,666.44
1. 利息收入		37,418.62	62,107.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	37,418.62	62,107.81
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		41,014,648.06	25,109,260.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	38,244,065.98	23,047,646.33

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	2,770,582.08	2,061,613.93
3. 公允价值变动收益 (损失 以“-”号填列)	6.4.7.17	-4,198,095.25	23,708,347.36
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	116,556.73	198,951.01
减: 二、费用		2,381,285.56	2,147,806.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,189,058.89	1,159,005.70
2. 托管费	6.4.10.2.2	237,811.79	231,801.10
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	32,764.75	24,204.28
4. 交易费用	6.4.7.19	707,238.79	518,098.17
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	214,411.34	214,697.62
三、利润总额 (亏损总额以“-” 号填列)		34,589,242.60	46,930,859.57
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-” 号填列)		34,589,242.60	46,930,859.57

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: 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)	198,691,003.01	123,974,847.21	322,665,850.22
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数 (本期 利润)	-	34,589,242.60	34,589,242.60
三、本期基金份	33,980,289.50	27,625,675.99	61,605,965.49

额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	187,071,641.02	136,883,161.26	323,954,802.28
2. 基金赎回款	-153,091,351.52	-109,257,485.27	-262,348,836.79
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)	232,671,292.51	186,189,765.80	418,861,058.31
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)	270,300,341.36	51,732,436.89	322,032,778.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	46,930,859.57	46,930,859.57
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)	-55,681,028.44	-15,797,482.03	-71,478,510.47
其中: 1. 基金申购款	175,632,638.30	49,597,000.88	225,229,639.18
2. 基金赎回款	-231,313,666.74	-65,394,482.91	-296,708,149.65
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)	214,619,312.92	82,865,814.43	297,485,127.35

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 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（含存托凭证）（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，为了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（含存托凭证）、新股（含存托凭证）（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 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 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	27,316,124.26
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	27,316,124.26

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	366,395,798.83	396,165,865.50	29,770,066.67
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	366,395,798.83	396,165,865.50	29,770,066.67

注：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

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,181.34

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	156.33
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	-
其他	19.26
合计	2,356.93

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	295,965.51
银行间市场应付交易费用	-
合计	295,965.51

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	4,250.98
应付证券出借违约金	-
预提费用	114,055.34
应付指数使用费	50,000.00
合计	168,306.32

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 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	176,851,874.81	176,851,874.81
本期申购	69,612,267.15	69,612,267.15
本期赎回（以“-”号填列）	-66,647,396.09	-66,647,396.09
-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	179,816,745.87	179,816,745.87

鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)

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	21,839,128.20	21,839,128.20
本期申购	117,459,373.87	117,459,373.87
本期赎回 (以“-”号填列)	-86,443,955.43	-86,443,955.43
-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	52,854,546.64	52,854,546.64

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

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	182,732,941.87	-74,075,194.92	108,657,746.95
本期利润	35,293,928.36	-5,811,892.94	29,482,035.42
本期基金份额 交易产生的变 动数	3,983,902.03	-2,076,361.75	1,907,540.28
其中：基金申 购款	76,621,525.56	-30,627,641.67	45,993,883.89
基金赎 回款	-72,637,623.53	28,551,279.92	-44,086,343.61
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	222,010,772.26	-81,963,449.61	140,047,322.65

鹏华中证 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	7,398,104.21	7,918,996.05	15,317,100.26
本期利润	3,493,409.49	1,613,797.69	5,107,207.18
本期基金份额 交易产生的变 动数	18,142,418.61	7,575,717.10	25,718,135.71
其中：基金申 购款	53,679,917.87	37,209,359.50	90,889,277.37
基金赎 回款	-35,537,499.26	-29,633,642.40	-65,171,141.66

回款			
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,033,932.31	17,108,510.84	46,142,443.15

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	34,422.23
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	2,202.72
其他	793.67
合计	37,418.62

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	38,244,065.98
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	38,244,065.98

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	211,748,294.07
减：卖出股票成本总额	173,504,228.09
买卖股票差价收入	38,244,065.98

6.4.7.12.3 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

注：无。

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	2,770,582.08
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	2,770,582.08

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	-4,198,095.25
股票投资	-4,198,095.25
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	-4,198,095.25

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	111,231.96
基金转换费收入	5,324.77
合计	116,556.73

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	707,238.79
银行间市场交易费用	—
合计	707,238.79

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行汇划费用	356.00
指数使用费	100,000.00
上市年费	29,752.78
合计	214,411.34

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 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	100,294,262.43	21.25	98,528,315.71	33.97

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	93,060.41	21.41	70,490.08	23.82
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	91,637.26	34.33	18,762.76	14.55

注：（1）佣金的计算公式

$$\text{上海/深圳证券交易所的交易佣金} = \text{股票买(卖)成交金额} \times \text{佣金比率} - \text{买(卖)经手费} - \text{买(卖)}$$

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	1,189,058.89	1,159,005.70
其中：支付销售机构的客户维护费	443,378.16	345,029.97

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 0.75%，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 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托管费	237,811.79	231,801.10

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费年费率为 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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)	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)	合计

鹏华基金公司	-	5,972.85	5,972.85
合计	-	5,972.85	5,972.85
获得销售服务费的各关联方名称	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)	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)	合计
鹏华基金公司	-	5,707.47	5,707.47
合计	-	5,707.47	5,707.47

注：鹏华中证 500 指数 A 类（LOF）基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华中证 500 指数 C 类（LOF）基金份额的销售服务费年费率为 0.20%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日分类基金资产净值×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：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

注：无。

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固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	27,316,124.26	34,422.23	17,159,366.98	56,893.47

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	1,975	93,476.75
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	366	9,003.60	59,658.00	-
300927	江天	2020 年	2021 年	锁定期	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-

	化学	12 月 29 日	7 月 7 日	股票						
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	492	12,147.48	15,601.32	-
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	354	7,543.74	17,678.76	-
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	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。
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	-

		日	日							
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	198	9,371.34	49,888.08	-
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 15 日	锁定期 股票	28.28	115.71	288	8,144.64	33,324.48	-
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	2021 年	2021 年	锁定期	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-

	科技	4 月 15 日	10 月 26 日	股票						
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	361	11,992.42	31,587.50	-
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	236	11,467.24	21,332.04	-
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	295	7,345.50	7,318.95	-
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	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	锁定期股票	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
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	-

		日	日							
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	-
688131	皓元医药	2021 年 6 月 1 日	2021 年 12 月 8 日	锁定期 股票	64.99	247.10	1,877	121,986.23	463,806.70	-
688161	威高骨科	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	锁定期 股票	36.22	82.27	2,308	83,595.76	189,879.16	-
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	-
688355	明志科技	2021 年 4 月 30 日	2021 年 11 月 12 日	锁定期 股票	17.65	23.80	2,710	47,831.50	64,498.00	-
688395	正弦电气	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	锁定期 股票	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99	-
688425	铁建重工	2021 年 6 月 11 日	2021 年 12 月 22 日	锁定期 股票	2.87	4.75	35,753	102,611.11	169,826.75	-
688565	力源科技	2021 年 5 月 6 日	2021 年 11 月 15 日	锁定期 股票	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00	-
688601	力芯微	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 28 日	锁定期 股票	36.48	133.69	1,174	42,827.52	156,952.06	-
688669	聚石化学	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 26 日	锁定期 股票	36.65	32.39	2,681	98,258.65	86,837.59	-

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，锁定期限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。

6.4.12.2 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	50,369	1,358,376.61	2,838,293.15	-
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	191,540	706,895.45	584,197.00	-

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

注：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同责任，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 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期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。

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 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	27,316,124.26	-	-	-	27,316,124.26
结算备付金	386,012.82	-	-	-	386,012.82
存出保证金	47,702.28	-	-	-	47,702.28
交易性金融资产	-	-	-	396,165,865.50	396,165,865.50
应收利息	-	-	-	2,356.93	2,356.93
应收申购款	-	-	-	2,419,588.10	2,419,588.10
资产总计	27,749,839.36	-	-	398,587,810.53	426,337,649.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,956,963.03	3,956,963.03
应付管理人报酬	-	-	-	213,747.10	213,747.10
应付托管费	-	-	-	42,749.44	42,749.44
应付证券清算款	-	-	-	2,793,151.60	2,793,151.60
应付销售服务费	-	-	-	5,708.58	5,708.58
应付交易费用	-	-	-	295,965.51	295,965.51
其他负债	-	-	-	168,306.32	168,306.32
负债总计	-	-	-	7,476,591.58	7,476,591.58
利率敏感度缺口	27,749,839.36	-	-	391,111,218.95	418,861,058.31
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	18,947,966.32	-	-	-	18,947,966.32
结算备付金	8,192.44	-	-	-	8,192.44
存出保证金	45,962.34	-	-	-	45,962.34
交易性金融资产	-	-	-	306,360,774.49	306,360,774.49
应收利息	-	-	-	1,818.19	1,818.19
应收申购款	-	-	-	644,052.49	644,052.49
应收证券清算款	-	-	-	672,305.22	672,305.22
资产总计	19,002,121.10	-	-	307,678,950.39	326,681,071.49

负债					
应付赎回款	-	-	-	3,330,549.74	3,330,549.74
应付管理人报酬	-	-	-	203,461.55	203,461.55
应付托管费	-	-	-	40,692.33	40,692.33
应付销售服务费	-	-	-	6,306.87	6,306.87
应付交易费用	-	-	-	149,351.42	149,351.42
其他负债	-	-	-	284,859.36	284,859.36
负债总计	-	-	-	4,015,221.27	4,015,221.27
利率敏感度缺口	19,002,121.10	-	-	-303,663,729.12	322,665,850.22

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 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	396,165,865.50	94.58	306,360,774.49	94.95
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	396,165,865.50	94.58	306,360,774.49	94.95

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%	20,295,593.84	15,558,148.43
	业绩比较基准下降 5%	-20,295,593.84	-15,558,148.43

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	396,165,865.50	92.92
	其中：股票	396,165,865.50	92.92
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	27,702,137.08	6.50
8	其他各项资产	2,469,647.31	0.58
9	合计	426,337,649.89	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	3,889,489.16	0.93
B	采矿业	13,826,402.21	3.30
C	制造业	248,955,849.19	59.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,589,166.14	2.29
E	建筑业	7,285,563.89	1.74
F	批发和零售业	13,228,214.62	3.16
G	交通运输、仓储和邮政业	7,661,997.94	1.83
H	住宿和餐饮业	2,094,687.00	0.50
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,530,166.47	7.77
J	金融业	23,477,664.90	5.61
K	房地产业	12,951,110.99	3.09
L	租赁和商务服务业	5,233,323.60	1.25
M	科学研究和技术服务业	1,041,149.00	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	3,367,795.77	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	250,359.80	0.06
Q	卫生和社会工作	1,065,506.00	0.25

R	文化、体育和娱乐业	3,985,339.00	0.95
S	综合	3,495,996.61	0.83
	合计	393,929,782.29	94.05

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	1,514,378.06	0.36
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	48,156.40	0.01
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	463,806.70	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	78,934.33	0.02
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	2,236,083.21	0.53

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	36,756	3,917,454.48	0.94
2	000799	酒鬼酒	14,500	3,706,200.00	0.88

3	603486	科沃斯	14,680	3,348,214.40	0.80
4	600089	特变电工	241,200	3,099,420.00	0.74
5	000009	中国宝安	167,280	3,056,205.60	0.73
6	002340	格林美	311,315	2,910,795.25	0.69
7	002074	国轩高科	66,000	2,874,960.00	0.69
8	600460	士兰微	50,369	2,838,293.15	0.68
9	300285	国瓷材料	51,700	2,520,375.00	0.60
10	601233	桐昆股份	103,900	2,502,951.00	0.60
11	300207	欣旺达	71,300	2,321,528.00	0.55
12	002185	华天科技	142,500	2,193,075.00	0.52
13	600885	宏发股份	33,580	2,105,466.00	0.50
14	300316	晶盛机电	41,400	2,090,700.00	0.50
15	601636	旗滨集团	104,500	1,939,520.00	0.46
16	600733	北汽蓝谷	139,700	1,883,156.00	0.45
17	300037	新宙邦	18,100	1,811,810.00	0.43
18	300146	汤臣倍健	55,000	1,809,500.00	0.43
19	300253	卫宁健康	111,000	1,805,970.00	0.43
20	002648	卫星石化	44,640	1,749,441.60	0.42
21	002625	光启技术	84,000	1,748,040.00	0.42
22	002223	鱼跃医疗	45,405	1,731,292.65	0.41
23	600884	杉杉股份	73,632	1,717,098.24	0.41
24	600219	南山铝业	467,500	1,683,000.00	0.40
25	601127	小康股份	24,900	1,660,083.00	0.40
26	002353	杰瑞股份	37,000	1,653,900.00	0.39
27	002138	顺络电子	41,600	1,612,832.00	0.39
28	603737	三棵树	9,140	1,608,640.00	0.38
29	000547	航天发展	83,000	1,566,210.00	0.37
30	002797	第一创业	219,200	1,565,088.00	0.37
31	600779	水井坊	12,200	1,541,470.00	0.37
32	603589	口子窖	22,700	1,536,563.00	0.37
33	000988	华工科技	65,150	1,532,328.00	0.37
34	002444	巨星科技	44,495	1,516,389.60	0.36
35	002212	天融信	76,400	1,510,428.00	0.36
36	300699	光威复材	19,800	1,503,810.00	0.36
37	601099	太平洋	443,600	1,503,804.00	0.36
38	601168	西部矿业	124,200	1,481,706.00	0.35
39	002422	科伦药业	74,000	1,476,300.00	0.35
40	002385	大北农	216,000	1,468,800.00	0.35
41	688099	晶晨股份	13,012	1,459,946.40	0.35
42	000807	云铝股份	122,200	1,454,180.00	0.35
43	600739	辽宁成大	69,400	1,444,214.00	0.34
44	603893	瑞芯微	10,200	1,422,492.00	0.34

45	300308	中际旭创	36,700	1,413,684.00	0.34
46	002439	启明星辰	48,400	1,404,084.00	0.34
47	000636	风华高科	46,300	1,399,186.00	0.33
48	688002	睿创微纳	14,010	1,398,618.30	0.33
49	000830	鲁西化工	74,227	1,390,271.71	0.33
50	600862	中航高科	45,000	1,385,100.00	0.33
51	600392	盛和资源	79,729	1,384,095.44	0.33
52	002078	太阳纸业	102,428	1,367,413.80	0.33
53	002030	达安基因	63,688	1,352,733.12	0.32
54	601117	中国化学	154,000	1,349,040.00	0.32
55	600068	葛洲坝	179,600	1,345,204.00	0.32
56	600704	物产中大	170,400	1,341,048.00	0.32
57	002180	纳思达	41,600	1,339,520.00	0.32
58	600754	锦江酒店	23,500	1,338,325.00	0.32
59	600699	均胜电子	52,360	1,336,227.20	0.32
60	002250	联化科技	47,649	1,329,407.10	0.32
61	300088	长信科技	159,700	1,319,122.00	0.31
62	600486	扬农化工	11,700	1,307,709.00	0.31
63	000630	铜陵有色	480,700	1,307,504.00	0.31
64	600563	法拉电子	8,223	1,302,194.28	0.31
65	600315	上海家化	21,513	1,293,791.82	0.31
66	002507	涪陵榨菜	34,300	1,291,738.00	0.31
67	600201	生物股份	72,938	1,272,768.10	0.30
68	603444	吉比特	2,400	1,272,000.00	0.30
69	002013	中航机电	126,200	1,270,834.00	0.30
70	000039	中集集团	69,420	1,262,055.60	0.30
71	002075	沙钢股份	114,400	1,248,104.00	0.30
72	002127	南极电商	127,400	1,244,698.00	0.30
73	600909	华安证券	219,650	1,223,450.50	0.29
74	300001	特锐德	40,200	1,210,422.00	0.29
75	002028	思源电气	39,224	1,207,706.96	0.29
76	000513	丽珠集团	24,020	1,201,480.40	0.29
77	603605	珀莱雅	6,100	1,199,931.00	0.29
78	600177	雅戈尔	180,800	1,191,472.00	0.28
79	601997	贵阳银行	166,400	1,191,424.00	0.28
80	300223	北京君正	11,800	1,190,856.00	0.28
81	601005	重庆钢铁	437,800	1,168,926.00	0.28
82	002511	中顺洁柔	42,400	1,168,120.00	0.28
83	002273	水晶光电	79,184	1,163,212.96	0.28
84	000021	深科技	60,656	1,160,955.84	0.28
85	002299	圣农发展	48,400	1,155,792.00	0.28
86	002092	中泰化学	111,668	1,146,830.36	0.27

87	600549	厦门钨业	54,800	1,141,484.00	0.27
88	600988	赤峰黄金	75,800	1,136,242.00	0.27
89	002465	海格通信	119,900	1,134,254.00	0.27
90	000050	深天马 A	79,800	1,131,564.00	0.27
91	002080	中材科技	43,000	1,125,310.00	0.27
92	300168	万达信息	76,800	1,121,280.00	0.27
93	002603	以岭药业	38,300	1,116,828.00	0.27
94	000825	太钢不锈	148,600	1,113,014.00	0.27
95	300009	安科生物	74,572	1,111,122.80	0.27
96	000983	山西焦煤	133,290	1,107,639.90	0.26
97	601128	常熟银行	178,400	1,106,080.00	0.26
98	000739	普洛药业	37,600	1,105,440.00	0.26
99	600516	方大炭素	148,500	1,104,840.00	0.26
100	600867	通化东宝	92,400	1,103,256.00	0.26
101	600066	宇通客车	87,900	1,097,871.00	0.26
102	000998	隆平高科	68,404	1,097,200.16	0.26
103	600637	东方明珠	133,300	1,091,727.00	0.26
104	300482	万孚生物	16,850	1,090,026.50	0.26
105	300618	寒锐钴业	13,700	1,080,108.00	0.26
106	600536	中国软件	18,800	1,070,284.00	0.26
107	600418	江淮汽车	85,868	1,067,339.24	0.25
108	600316	洪都航空	27,700	1,065,896.00	0.25
109	300244	迪安诊断	27,820	1,065,506.00	0.25
110	300357	我武生物	16,600	1,064,392.00	0.25
111	600879	航天电子	141,400	1,063,328.00	0.25
112	601689	拓普集团	28,315	1,059,830.45	0.25
113	600369	西南证券	216,500	1,054,355.00	0.25
114	300070	碧水源	144,200	1,054,102.00	0.25
115	000932	华菱钢铁	159,560	1,053,096.00	0.25
116	300463	迈克生物	25,000	1,052,250.00	0.25
117	000750	国海证券	248,080	1,051,859.20	0.25
118	600487	亨通光电	92,000	1,048,800.00	0.25
119	600171	上海贝岭	34,462	1,048,678.66	0.25
120	002152	广电运通	80,400	1,047,612.00	0.25
121	600380	健康元	75,848	1,041,393.04	0.25
122	600827	百联股份	51,600	1,039,740.00	0.25
123	600529	山东药玻	30,600	1,038,870.00	0.25
124	000960	锡业股份	64,700	1,037,141.00	0.25
125	600166	福田汽车	299,600	1,033,620.00	0.25
126	300296	利亚德	132,100	1,033,022.00	0.25
127	000975	银泰黄金	108,320	1,030,123.20	0.25
128	300271	华宇软件	53,500	1,029,875.00	0.25

129	002156	通富微电	42,800	1,028,912.00	0.25
130	002131	利欧股份	439,040	1,027,353.60	0.25
131	002373	千方科技	61,414	1,025,613.80	0.24
132	000723	美锦能源	135,200	1,022,112.00	0.24
133	601615	明阳智能	63,000	1,019,970.00	0.24
134	300383	光环新网	70,100	1,008,739.00	0.24
135	002572	索菲亚	41,300	999,460.00	0.24
136	002926	华西证券	102,300	985,149.00	0.24
137	688208	道通科技	11,291	982,204.09	0.23
138	600642	申能股份	159,800	981,172.00	0.23
139	600038	中直股份	18,600	980,964.00	0.23
140	601198	东兴证券	89,400	977,142.00	0.23
141	601866	中远海发	258,400	969,000.00	0.23
142	300115	长盈精密	46,602	960,001.20	0.23
143	002065	东华软件	121,000	959,530.00	0.23
144	002690	美亚光电	17,000	947,920.00	0.23
145	600271	航天信息	72,200	940,766.00	0.22
146	002500	山西证券	139,970	939,198.70	0.22
147	600998	九州通	60,600	931,422.00	0.22
148	000623	吉林敖东	60,100	930,949.00	0.22
149	603156	养元饮品	32,500	928,850.00	0.22
150	600415	小商品城	178,700	920,305.00	0.22
151	603638	艾迪精密	21,420	918,275.40	0.22
152	000012	南 玻 A	89,238	913,797.12	0.22
153	600895	张江高科	50,000	913,500.00	0.22
154	300474	景嘉微	9,300	910,656.00	0.22
155	601699	潞安环能	77,000	909,370.00	0.22
156	600153	建发股份	111,700	904,770.00	0.22
157	603260	合盛硅业	11,700	899,847.00	0.21
158	002294	信立泰	27,000	888,300.00	0.21
159	600188	兖州煤业	57,800	887,808.00	0.21
160	600256	广汇能源	264,100	879,453.00	0.21
161	600707	彩虹股份	93,100	876,071.00	0.21
162	600390	五矿资本	146,300	874,874.00	0.21
163	300630	普利制药	16,640	871,936.00	0.21
164	600667	太极实业	95,800	871,780.00	0.21
165	300418	昆仑万维	53,200	871,416.00	0.21
166	600535	天士力	58,800	870,828.00	0.21
167	603290	斯达半导	2,700	864,000.00	0.21
168	600008	首创环保	286,830	863,358.30	0.21
169	300024	机器人	80,900	863,203.00	0.21
170	600497	驰宏锌锗	199,000	857,690.00	0.20

171	002670	国盛金控	75,120	855,616.80	0.20
172	600060	海信视像	50,600	855,140.00	0.20
173	000027	深圳能源	93,000	852,810.00	0.20
174	000878	云南铜业	66,300	850,629.00	0.20
175	600208	新湖中宝	279,700	850,288.00	0.20
176	002372	伟星新材	41,120	849,950.40	0.20
177	600155	华创阳安	79,000	845,300.00	0.20
178	002382	蓝帆医疗	40,500	844,425.00	0.20
179	002557	洽洽食品	19,500	840,450.00	0.20
180	603858	步长制药	36,800	827,632.00	0.20
181	002019	亿帆医药	47,800	824,550.00	0.20
182	300251	光线传媒	76,100	822,641.00	0.20
183	600372	中航电子	49,700	822,535.00	0.20
184	600765	中航重机	36,295	822,081.75	0.20
185	600498	烽火通信	44,100	821,583.00	0.20
186	002221	东华能源	74,918	820,352.10	0.20
187	600141	兴发集团	43,418	817,560.94	0.20
188	000718	苏宁环球	98,400	815,736.00	0.19
189	600409	三友化工	80,502	813,875.22	0.19
190	002174	游族网络	47,400	813,858.00	0.19
191	600511	国药股份	24,292	803,093.52	0.19
192	002683	宏大爆破	28,900	802,553.00	0.19
193	600170	上海建工	289,400	798,744.00	0.19
194	002146	荣盛发展	141,400	797,496.00	0.19
195	002506	协鑫集成	229,000	796,920.00	0.19
196	002966	苏州银行	108,400	796,740.00	0.19
197	002390	信邦制药	75,800	794,384.00	0.19
198	600875	东方电气	72,100	790,937.00	0.19
199	000401	冀东水泥	64,000	790,400.00	0.19
200	000997	新 大 陆	47,586	789,451.74	0.19
201	300058	蓝色光标	129,600	784,080.00	0.19
202	601717	郑煤机	67,405	783,920.15	0.19
203	600801	华新水泥	44,230	777,121.10	0.19
204	002958	青农商行	180,900	774,252.00	0.18
205	002408	齐翔腾达	62,281	773,530.02	0.18
206	600160	巨化股份	87,380	772,439.20	0.18
207	000686	东北证券	91,000	768,950.00	0.18
208	000738	航发控制	36,800	766,544.00	0.18
209	603866	桃李面包	24,492	764,150.40	0.18
210	300315	掌趣科技	179,400	762,450.00	0.18
211	002195	二三四五	373,121	757,435.63	0.18
212	600663	陆家嘴	56,800	756,576.00	0.18

213	600258	首旅酒店	31,700	756,362.00	0.18
214	000540	中天金融	274,200	748,566.00	0.18
215	300017	网宿科技	127,700	747,045.00	0.18
216	002268	卫 士 通	38,180	743,746.40	0.18
217	600325	华发股份	110,175	742,579.50	0.18
218	603707	健友股份	17,700	738,975.00	0.18
219	000060	中金岭南	162,700	735,404.00	0.18
220	600732	爱旭股份	52,700	733,584.00	0.18
221	601016	节能风电	195,700	731,918.00	0.17
222	601992	金隅集团	271,300	729,797.00	0.17
223	603225	新凤鸣	35,920	729,176.00	0.17
224	600027	华电国际	211,800	728,592.00	0.17
225	000961	中南建设	122,800	726,976.00	0.17
226	600567	山鹰国际	209,600	723,120.00	0.17
227	600859	王府井	24,849	717,639.12	0.17
228	002831	裕同科技	24,160	717,310.40	0.17
229	688088	虹软科技	12,842	715,941.50	0.17
230	603077	和邦生物	343,680	714,854.40	0.17
231	688321	微芯生物	15,460	714,097.40	0.17
232	002429	兆驰股份	117,500	713,225.00	0.17
233	600282	南钢股份	200,200	712,712.00	0.17
234	603712	七一二	19,700	711,170.00	0.17
235	002191	劲嘉股份	66,424	706,751.36	0.17
236	600500	中化国际	89,500	703,470.00	0.17
237	600839	四川长虹	240,600	700,146.00	0.17
238	600528	中铁工业	86,400	699,840.00	0.17
239	601577	长沙银行	78,200	699,108.00	0.17
240	000671	阳 光 城	134,000	696,800.00	0.17
241	000158	常山北明	60,600	696,294.00	0.17
242	600216	浙江医药	43,400	694,834.00	0.17
243	600737	中粮糖业	69,300	693,693.00	0.17
244	002056	横店东磁	53,108	690,404.00	0.16
245	002081	金 螳 螂	87,100	689,832.00	0.16
246	600598	北大荒	46,100	689,656.00	0.16
247	300212	易华录	25,620	689,434.20	0.16
248	000898	鞍钢股份	154,700	688,415.00	0.16
249	603927	中科软	16,000	687,200.00	0.16
250	002595	豪迈科技	25,600	683,520.00	0.16
251	000709	河钢股份	276,000	678,960.00	0.16
252	600580	卧龙电驱	50,686	674,123.80	0.16
253	603198	迎驾贡酒	15,200	673,360.00	0.16
254	603883	老百姓	12,780	673,250.40	0.16

255	600728	佳都科技	90,800	672,828.00	0.16
256	000999	华润三九	25,100	671,425.00	0.16
257	002203	海亮股份	63,100	671,384.00	0.16
258	000581	威孚高科	32,200	670,726.00	0.16
259	002281	光迅科技	27,060	665,676.00	0.16
260	300182	捷成股份	133,400	665,666.00	0.16
261	600808	马钢股份	155,000	664,950.00	0.16
262	000729	燕京啤酒	91,300	661,012.00	0.16
263	002124	天邦股份	93,380	654,593.80	0.16
264	688029	南微医学	2,100	654,549.00	0.16
265	000930	中粮科技	72,547	653,648.47	0.16
266	600820	隧道股份	122,800	649,612.00	0.16
267	002010	传化智联	84,200	649,182.00	0.15
268	000488	晨鸣纸业	79,559	647,610.26	0.15
269	002387	维信诺	62,000	646,660.00	0.15
270	002745	木林森	48,000	643,200.00	0.15
271	000629	攀钢钒钛	280,000	641,200.00	0.15
272	002396	星网锐捷	30,000	640,500.00	0.15
273	300166	东方国信	51,719	639,246.84	0.15
274	002242	九阳股份	19,641	638,136.09	0.15
275	002004	华邦健康	102,635	637,363.35	0.15
276	600970	中材国际	67,850	622,184.50	0.15
277	002048	宁波华翔	31,872	621,504.00	0.15
278	002563	森马服饰	52,000	621,400.00	0.15
279	600755	厦门国贸	75,613	620,782.73	0.15
280	300002	神州泰岳	127,200	616,920.00	0.15
281	600022	山东钢铁	356,450	613,094.00	0.15
282	603000	人民网	35,600	611,964.00	0.15
283	600803	新奥股份	36,800	607,568.00	0.15
284	000598	兴蓉环境	116,400	606,444.00	0.14
285	600398	海澜之家	83,700	605,988.00	0.14
286	600037	歌华有线	62,900	604,469.00	0.14
287	600881	亚泰集团	211,268	602,113.80	0.14
288	002002	鸿达兴业	149,738	588,470.34	0.14
289	601880	辽港股份	341,722	584,344.62	0.14
290	600811	东方集团	191,540	584,197.00	0.14
291	000883	湖北能源	126,900	582,471.00	0.14
292	600039	四川路桥	92,750	581,542.50	0.14
293	002925	盈趣科技	14,940	581,315.40	0.14
294	000778	新兴铸管	155,800	579,576.00	0.14
295	603885	吉祥航空	37,900	578,354.00	0.14
296	600782	新钢股份	103,500	577,530.00	0.14

297	600348	华阳股份	77,800	577,276.00	0.14
298	000690	宝新能源	112,960	577,225.60	0.14
299	600260	凯乐科技	64,683	574,385.04	0.14
300	600597	光明乳业	39,800	573,518.00	0.14
301	601456	国联证券	37,200	572,880.00	0.14
302	000887	中鼎股份	47,200	570,176.00	0.14
303	002701	奥瑞金	110,053	565,672.42	0.14
304	601118	海南橡胶	111,000	564,990.00	0.13
305	002249	大洋电机	107,550	564,637.50	0.13
306	600126	杭钢股份	109,500	561,735.00	0.13
307	601106	中国一重	165,600	561,384.00	0.13
308	600908	无锡银行	96,700	560,860.00	0.13
309	600967	内蒙一机	55,100	557,612.00	0.13
310	002085	万丰奥威	99,500	557,200.00	0.13
311	600026	中远海能	90,256	555,976.96	0.13
312	002867	周大生	28,050	554,548.50	0.13
313	002705	新宝股份	21,100	553,875.00	0.13
314	600410	华胜天成	71,295	553,249.20	0.13
315	600645	中源协和	24,100	553,095.00	0.13
316	002183	怡亚通	96,200	551,226.00	0.13
317	603568	伟明环保	24,119	550,636.77	0.13
318	600718	东软集团	56,300	550,614.00	0.13
319	000528	柳工	67,080	550,056.00	0.13
320	601179	中国西电	133,100	548,372.00	0.13
321	600985	淮北矿业	44,500	543,345.00	0.13
322	600572	康恩贝	121,677	540,245.88	0.13
323	002110	三钢闽光	79,800	537,852.00	0.13
324	600167	联美控股	59,380	530,263.40	0.13
325	000877	天山股份	40,648	529,643.44	0.13
326	603650	彤程新材	11,000	529,100.00	0.13
327	002368	太极股份	26,197	525,511.82	0.13
328	000970	中科三环	55,000	525,250.00	0.13
329	600446	金证股份	36,300	524,172.00	0.13
330	300072	三聚环保	91,000	522,340.00	0.12
331	601200	上海环境	43,620	522,131.40	0.12
332	000402	金融街	77,300	521,775.00	0.12
333	002266	浙富控股	104,340	520,656.60	0.12
334	600064	南京高科	55,922	519,515.38	0.12
335	002128	露天煤业	49,800	518,418.00	0.12
336	000089	深圳机场	66,700	518,259.00	0.12
337	601598	中国外运	102,400	517,120.00	0.12
338	000990	诚志股份	40,400	514,292.00	0.12

339	600329	中新药业	18,062	507,361.58	0.12
340	600517	国网英大	74,300	505,983.00	0.12
341	300026	红日药业	116,800	496,400.00	0.12
342	600158	中体产业	43,371	494,863.11	0.12
343	000400	许继电气	38,800	491,208.00	0.12
344	003035	南网能源	49,100	488,054.00	0.12
345	601718	际华集团	171,800	484,476.00	0.12
346	300376	易事特	60,200	484,008.00	0.12
347	000519	中兵红箭	45,108	483,557.76	0.12
348	600120	浙江东方	112,690	482,313.20	0.12
349	002233	塔牌集团	46,352	476,498.56	0.11
350	000959	首钢股份	84,600	475,452.00	0.11
351	600507	方大特钢	70,110	475,345.80	0.11
352	601975	招商南油	221,600	474,224.00	0.11
353	600307	酒钢宏兴	203,400	471,888.00	0.11
354	600195	中牧股份	39,271	469,681.16	0.11
355	001914	招商积余	27,300	469,014.00	0.11
356	000090	天健集团	84,713	468,462.89	0.11
357	601333	广深铁路	220,900	468,308.00	0.11
358	000685	中山公用	57,374	468,171.84	0.11
359	600376	首开股份	83,600	468,160.00	0.11
360	002505	鹏都农牧	206,770	463,164.80	0.11
361	601000	唐山港	192,098	462,956.18	0.11
362	002985	北摩高科	4,710	459,225.00	0.11
363	002440	闰土股份	51,811	458,527.35	0.11
364	600435	北方导航	57,672	457,915.68	0.11
365	000559	万向钱潮	85,900	456,129.00	0.11
366	600804	鹏博士	92,600	448,184.00	0.11
367	002839	张家港行	82,100	446,624.00	0.11
368	600673	东阳光	97,949	439,791.01	0.10
369	600643	爱建集团	62,972	439,544.56	0.10
370	300133	华策影视	73,900	437,488.00	0.10
371	600373	中文传媒	44,000	433,840.00	0.10
372	601860	紫金银行	119,200	432,696.00	0.10
373	603228	景旺电子	16,288	426,745.60	0.10
374	000758	中色股份	89,600	425,600.00	0.10
375	601991	大唐发电	161,000	425,040.00	0.10
376	000967	盈峰环境	61,700	423,879.00	0.10
377	002155	湖南黄金	54,500	422,375.00	0.10
378	600056	中国医药	34,694	421,532.10	0.10
379	600582	天地科技	107,645	419,815.50	0.10
380	002038	双鹭药业	39,800	419,094.00	0.10

381	002936	郑州银行	114,070	418,636.90	0.10
382	601608	中信重工	111,500	417,010.00	0.10
383	600266	城建发展	87,528	414,882.72	0.10
384	600388	龙净环保	48,500	413,220.00	0.10
385	000563	陕国投 A	128,132	412,585.04	0.10
386	601098	中南传媒	46,400	409,248.00	0.10
387	600095	湘财股份	34,900	408,679.00	0.10
388	600131	国网信通	30,700	406,468.00	0.10
389	000681	视觉中国	31,400	406,002.00	0.10
390	601958	金钼股份	62,400	404,352.00	0.10
391	600928	西安银行	86,700	404,022.00	0.10
392	300113	顺网科技	31,161	403,223.34	0.10
393	600901	江苏租赁	77,300	401,960.00	0.10
394	600062	华润双鹤	33,612	400,318.92	0.10
395	002416	爱施德	39,800	399,194.00	0.10
396	300180	华峰超纤	80,300	397,485.00	0.09
397	600959	江苏有线	130,200	397,110.00	0.09
398	600649	城投控股	82,000	390,320.00	0.09
399	600094	大名城	103,400	389,818.00	0.09
400	000415	渤海租赁	161,000	389,620.00	0.09
401	600259	广晟有色	11,431	386,482.11	0.09
402	600764	中国海防	13,600	384,880.00	0.09
403	002399	海普瑞	24,100	383,913.00	0.09
404	003022	联泓新科	12,500	383,750.00	0.09
405	002458	益生股份	38,300	381,851.00	0.09
406	600776	东方通信	30,700	380,680.00	0.09
407	300741	华宝股份	7,500	380,400.00	0.09
408	600006	东风汽车	51,743	377,723.90	0.09
409	601611	中国核建	51,300	370,386.00	0.09
410	600546	山煤国际	51,400	369,052.00	0.09
411	600556	天下秀	34,900	368,544.00	0.09
412	600717	天津港	93,838	367,844.96	0.09
413	300257	开山股份	25,400	364,998.00	0.09
414	600633	浙数文化	50,700	364,026.00	0.09
415	000717	韶钢松山	78,900	362,151.00	0.09
416	002317	众生药业	41,802	359,915.22	0.09
417	600648	外高桥	24,000	354,720.00	0.08
418	600729	重庆百货	12,871	353,308.95	0.08
419	601928	凤凰传媒	49,400	352,716.00	0.08
420	600863	内蒙华电	150,800	351,364.00	0.08
421	002434	万里扬	43,200	350,352.00	0.08
422	000078	海王生物	107,277	349,723.02	0.08

423	600021	上海电力	50,500	348,955.00	0.08
424	000501	鄂武商 A	29,585	346,144.50	0.08
425	002375	亚厦股份	43,300	342,936.00	0.08
426	000028	国药一致	9,057	342,716.88	0.08
427	600968	海油发展	131,700	341,103.00	0.08
428	002244	滨江集团	80,892	338,937.48	0.08
429	601828	美凯龙	28,200	338,400.00	0.08
430	002424	贵州百灵	45,700	336,352.00	0.08
431	000062	深圳华强	19,860	335,832.60	0.08
432	600835	上海机电	20,546	333,872.50	0.08
433	600623	华谊集团	36,500	321,565.00	0.08
434	600377	宁沪高速	31,900	311,344.00	0.07
435	603355	莱克电气	5,000	311,150.00	0.07
436	600339	中油工程	108,900	309,276.00	0.07
437	000869	张裕 A	8,300	308,262.00	0.07
438	600312	平高电气	52,312	305,502.08	0.07
439	600787	中储股份	57,034	303,991.22	0.07
440	002468	申通快递	39,700	302,514.00	0.07
441	002583	海能达	59,800	301,392.00	0.07
442	600566	济川药业	16,800	300,720.00	0.07
443	000031	大悦城	83,383	300,178.80	0.07
444	600639	浦东金桥	21,900	298,935.00	0.07
445	000826	启迪环境	55,400	296,390.00	0.07
446	600823	世茂股份	72,800	294,112.00	0.07
447	601778	晶科科技	53,800	293,748.00	0.07
448	601969	海南矿业	25,100	291,913.00	0.07
449	600466	蓝光发展	97,960	288,982.00	0.07
450	002815	崇达技术	22,600	282,048.00	0.07
451	601298	青岛港	45,600	281,808.00	0.07
452	603888	新华网	13,200	279,444.00	0.07
453	605358	立昂微	2,400	277,392.00	0.07
454	002532	天山铝业	32,900	276,031.00	0.07
455	000156	华数传媒	35,800	276,018.00	0.07
456	603317	天味食品	9,280	273,110.40	0.07
457	000937	冀中能源	69,000	271,170.00	0.06
458	603708	家家悦	15,400	267,498.00	0.06
459	002948	青岛银行	53,400	265,398.00	0.06
460	000813	德展健康	58,100	263,774.00	0.06
461	002635	安洁科技	17,753	259,726.39	0.06
462	000553	安道麦 A	27,900	258,633.00	0.06
463	002302	西部建设	32,600	257,540.00	0.06
464	300010	豆神教育	45,300	256,851.00	0.06

465	601228	广州港	80,400	255,672.00	0.06
466	603377	东方时尚	23,420	250,359.80	0.06
467	600350	山东高速	40,300	247,845.00	0.06
468	001872	招商港口	14,600	247,032.00	0.06
469	600640	号百控股	20,200	246,238.00	0.06
470	601139	深圳燃气	37,100	243,376.00	0.06
471	600871	石化油服	123,100	242,507.00	0.06
472	000061	农产品	43,900	242,328.00	0.06
473	603515	欧普照明	9,300	238,731.00	0.06
474	000046	泛海控股	101,600	233,680.00	0.06
475	601568	北元集团	25,600	219,136.00	0.05
476	603056	德邦股份	19,600	215,404.00	0.05
477	002653	海思科	9,900	213,048.00	0.05
478	603379	三美股份	11,200	209,552.00	0.05
479	002419	天虹股份	30,800	202,048.00	0.05
480	601003	柳钢股份	32,900	194,110.00	0.05
481	600657	信达地产	55,700	193,836.00	0.05
482	601512	中新集团	19,200	191,232.00	0.05
483	002901	大博医疗	2,600	189,514.00	0.05
484	000537	广宇发展	36,000	188,280.00	0.04
485	601801	皖新传媒	38,500	181,720.00	0.04
486	603786	科博达	2,400	181,200.00	0.04
487	601869	长飞光纤	7,300	177,828.00	0.04
488	601187	厦门银行	18,400	174,432.00	0.04
489	002946	新乳业	11,000	166,650.00	0.04
490	600917	重庆燃气	19,900	162,583.00	0.04
491	603983	丸美股份	3,000	156,330.00	0.04
492	603719	良品铺子	3,300	148,500.00	0.04
493	000732	泰禾集团	64,700	139,752.00	0.03
494	600903	贵州燃气	14,500	133,400.00	0.03
495	603868	飞科电器	2,800	117,768.00	0.03
496	002818	富森美	9,410	113,484.60	0.03
497	002423	中粮资本	11,600	104,980.00	0.03
498	603256	宏和科技	11,200	102,368.00	0.02
499	600956	新天绿能	8,600	100,706.00	0.02
500	601068	中铝国际	19,600	67,620.00	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	688131	皓元医药	1,877	463,806.70	0.11

2	688161	威高骨科	2,308	189,879.16	0.05
3	688425	铁建重工	35,753	169,826.75	0.04
4	688601	力芯微	1,174	156,952.06	0.04
5	688669	聚石化学	2,681	86,837.59	0.02
6	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
7	688355	明志科技	2,710	64,498.00	0.02
8	300919	中伟股份	366	59,658.00	0.01
9	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
10	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
11	300957	贝泰妮	198	49,888.08	0.01
12	688260	昀冢科技	2,990	49,065.90	0.01
13	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
14	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.01
15	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
16	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.01
17	300973	立高食品	288	33,324.48	0.01
18	300979	华利集团	361	31,587.50	0.01
19	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
20	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
21	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.01
22	300981	中红医疗	236	21,332.04	0.01
23	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
24	300941	创识科技	354	17,678.76	0.00
25	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
26	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
27	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
28	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
29	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
30	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
31	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
32	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
33	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
34	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
35	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
36	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
37	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
38	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
39	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
40	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
41	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
42	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
43	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
44	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00

45	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
46	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
47	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
48	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
49	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
50	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
51	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
52	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
53	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
54	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
55	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
56	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
57	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
58	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
59	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
60	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
61	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
62	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
63	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
64	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
65	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
66	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
67	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
68	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
69	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
70	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
71	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
72	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
73	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	3,618,236.00	1.12
2	002340	格林美	1,875,097.00	0.58
3	601636	旗滨集团	1,871,225.00	0.58
4	600089	特变电工	1,849,623.00	0.57
5	300274	阳光电源	1,815,701.00	0.56
6	300253	卫宁健康	1,755,597.00	0.54
7	300037	新宙邦	1,679,432.00	0.52
8	002709	天赐材料	1,589,999.60	0.49
9	002422	科伦药业	1,462,405.00	0.45

10	002439	启明星辰	1,446,239.00	0.45
11	601233	桐昆股份	1,437,377.00	0.45
12	300308	中际旭创	1,436,363.00	0.45
13	300285	国瓷材料	1,370,548.34	0.42
14	002074	国轩高科	1,338,060.00	0.41
15	002625	光启技术	1,324,490.00	0.41
16	600177	雅戈尔	1,299,009.00	0.40
17	600068	葛洲坝	1,254,326.00	0.39
18	600988	赤峰黄金	1,199,059.72	0.37
19	603893	瑞芯微	1,196,675.00	0.37
20	603486	科沃斯	1,192,134.00	0.37

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	7,199,770.97	2.23
2	300012	华测检测	4,000,165.09	1.24
3	002568	百润股份	3,825,557.60	1.19
4	600426	华鲁恒升	3,640,653.66	1.13
5	300595	欧普康视	2,967,168.60	0.92
6	300496	中科创达	2,920,656.20	0.91
7	600143	金发科技	2,831,304.00	0.88
8	002791	坚朗五金	2,819,176.00	0.87
9	600132	重庆啤酒	2,784,038.00	0.86
10	603882	金域医学	2,664,258.00	0.83
11	603806	福斯特	2,267,879.80	0.70
12	601966	玲珑轮胎	2,177,432.00	0.67
13	600079	人福医药	2,030,498.94	0.63
14	601799	星宇股份	1,979,954.00	0.61
15	603345	安井食品	1,889,922.00	0.59
16	300146	汤臣倍健	1,884,747.64	0.58
17	603816	顾家家居	1,826,360.00	0.57
18	002683	宏大爆破	1,565,070.00	0.49
19	300699	光威复材	1,506,301.56	0.47
20	300463	迈克生物	1,336,774.00	0.41

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	267,507,414.35
卖出股票收入（成交）总额	211,748,294.07

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：无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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	47,702.28
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	2,356.93
5	应收申购款	2,419,588.10
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,469,647.31

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	2,838,293.15	0.68	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	688131	皓元医药	463,806.70	0.11	锁定期股票
2	688161	威高骨科	189,879.16	0.05	锁定期股票
3	688425	铁建重工	169,826.75	0.04	锁定期股票
4	688601	力芯微	156,952.06	0.04	锁定期股票
5	688669	聚石化学	86,837.59	0.02	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

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)	44,352	4,054.31	850,127.62	0.47	178,966,618.25	99.53
鹏华中证 500 指数 C 类(LOF)	1,530	34,545.46	32,306,122.17	61.12	20,548,424.47	38.88
合计	45,882	5,071.08	33,156,249.79	14.25	199,515,042.72	85.75

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	赵建伟	428,372.00	6.55
2	张宏旭	200,012.00	3.06
3	施红梅	197,014.00	3.01
4	戴晨杰	183,893.00	2.81
5	陈吉荃	150,042.00	2.29
6	张宇	133,500.00	2.04
7	卢翠馨	120,000.00	1.84
8	鹿敏理	119,003.00	1.82
9	俞富良	117,026.00	1.79
10	于兆瑞	107,360.00	1.64

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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)	35,319.45	0.0196
	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)	75,451.25	0.1428
	合计	110,770.70	0.0476

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）	鹏华中证 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	176,851,874.81	21,839,128.20
本报告期基金总申购份额	69,612,267.15	117,459,373.87
减：本报告期基金总赎回份额	66,647,396.09	86,443,955.43
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	179,816,745.87	52,854,546.64

§ 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。

基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动：

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	
长江证券	1	144,077,292.06	30.52%	131,303.69	30.21%	-
银河证券	1	139,375,566.60	29.52%	129,800.84	29.86%	-
国信证券	2	100,294,262.43	21.25%	93,060.41	21.41%	-
广发证券	1	88,313,386.78	18.71%	80,482.27	18.52%	-

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

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	成交金额	占当期权 证 成交总额的 比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

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	2021 年 01 月 16 日

		基金电子披露网站	
4	鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）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关于旗下部分基金参与浙商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 02 月 02 日
8	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
9	鹏华基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《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 02 月 08 日
10	鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）更新的招募说明书	《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 10 日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、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 06 日
12	鹏华基金管理有限公司关于对旗下基金中基金资产管理计划通过直销渠道申购、赎回、转换旗下公募基金免除相关费用的公告	《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 09 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、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 10 日
14	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
15	鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）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
16	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
17	鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）2020 年年度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2021 年 03 月 30 日

		基金电子披露网站	
18	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
19	鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）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
20	鹏华中证 500 指数证券投资基金（A 类基金份额）（LOF）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
21	鹏华中证 500 指数证券投资基金（C 类基金份额）（LOF）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
22	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
23	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中泰证券股份有限公司申购（含定期定额投资）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 04 月 13 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与宁波银行股份有限公司申购（不含定期定额投资）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 04 月 14 日
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与天风证券股份有限公司申购（含定期定额投资）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 04 月 16 日
26	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低申购（含定期定额投资）金额、单笔最低转换份额和账户最低余额限制的公告	《中国证券报》、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 19 日
27	鹏华中证 500 指数证券投资基金（A 类基金份额）（LOF）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 04 月 20 日
28	鹏华中证 500 指数证券投资基金（C 类基金份额）（LOF）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 04 月 20 日
29	鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）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
30	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

31	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
32	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
33	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
34	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司相关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 05 月 14 日
35	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

注：无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）《鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- （二）《鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- （三）《鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）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