

鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF） 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 月 29 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。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师对本基金出具了“标准无保留意见”的审计报告。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况	12
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	18
4.10 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	18
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	19
§ 6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§ 7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	25

§ 8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
8.3 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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
8.6 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	74
8.7 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	74
8.8 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	74
8.9 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	74
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	75
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
8.12 投资组合报告附注	75
§ 9 基金份额持有人信息	76
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	76
9.2 期末上市基金前十名持有人	76
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	77
9.4 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	77
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	77
§ 10 开放式基金份额变动	77
§ 11 重大事件揭示	78
11.1 基金份额持有人大会决议	78
11.2 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	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	78
11.4 基金投资策略的改变	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	79
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	79
11.8 其他重大事件	80
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	86
12.1 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	86
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	86
§ 13 备查文件目录	86
13.1 备查文件目录	86
13.2 存放地点	86
13.3 查阅方式	86

§ 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	272,359,058.06 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	192,963,543.71 份	79,395,514.35 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。

1、资产配置策略

为实现紧密跟踪业绩比较基准的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值 90%的资产投资于中证 500 指数成份股和备选成份股,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。

2、股票投资策略

(1) 股票投资组合的构建

本基金在建仓期内,将按照中证 500 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,对基金资产进行适当调整,以期在规定的风险承受度之内,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中证 500 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、新股增发因素等变化,对其进行适时调整,以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将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。

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。

2) 不定期调整

根据指数编制规则,当中证 500 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。

(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。

3、债券投资策略

本基金可以根据流动性管理需要,选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。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。
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	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2021 年	2020 年	2019 年	2019 年 1 月 22 日(基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日

	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)	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	72,474,526. 51	7,306,747.2 5	60,015,416. 29	6,982,761. 15	3,817,634.5 7	320,887.91
本期 利润	60,991,452. 48	10,645,555. 78	89,439,353. 56	7,307,427. 78	76,268,234. 59	570,444.82
加权 平均 基金 份额 本期 利润	0.3371	0.4829	0.4323	0.3236	0.2773	0.0393
本期 加权 平均 净值 利润 率	18.94%	25.65%	30.79%	21.17%	25.07%	3.33%
本期 基金 份额 净值 增长 率	20.94%	20.81%	35.86%	35.54%	29.69%	25.50%
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末 可供 分配 利润	183,739,570 .95	60,257,087. 53	108,657,746 .95	7,398,104. 21	48,569,387. 83	260,545.29
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.9522	0.7589	0.6144	0.3388	0.1883	0.0210
期末	376,703,114	163,131,329	285,509,621	37,156,228	306,455,840	15,576,938

基金资产净值	.66	.13	.76	.46	.07	.18
期末基金份额净值	1.952	2.055	1.614	1.701	1.188	1.255
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金份额累计净值增长率	95.20%	105.50%	61.40%	70.10%	18.80%	25.50%

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等未实现收益。

(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 12 月 31 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
过去三个月	3.66%	0.71%	3.44%	0.72%	0.22%	-0.01%
过去六个月	9.72%	0.90%	7.73%	0.91%	1.99%	-0.01%

过去一年	20.94%	0.92%	14.85%	0.92%	6.09%	0.00%
过去三年	113.10%	1.31%	72.38%	1.31%	40.72%	0.00%
过去五年	52.14%	1.27%	17.37%	1.27%	34.77%	0.00%
自基金合同生效起至今	95.20%	1.59%	66.49%	1.55%	28.71%	0.04%

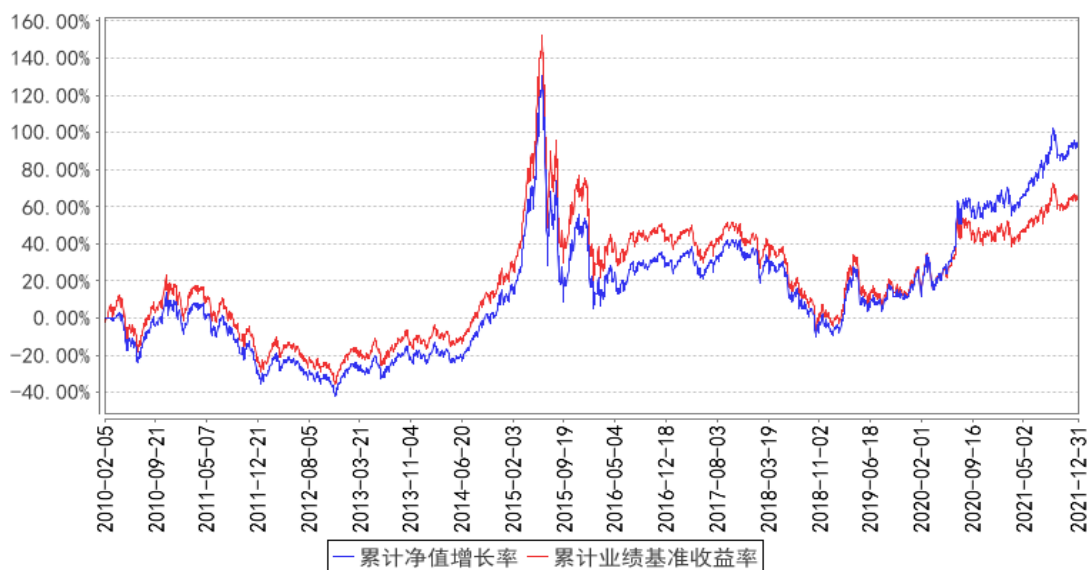
鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)

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
过去三个月	3.68%	0.71%	3.44%	0.72%	0.24%	-0.01%
过去六个月	9.72%	0.90%	7.73%	0.91%	1.99%	-0.01%
过去一年	20.81%	0.92%	14.85%	0.92%	5.96%	0.00%
自基金合同生效起至今	105.50%	1.32%	64.66%	1.32%	40.84%	0.00%

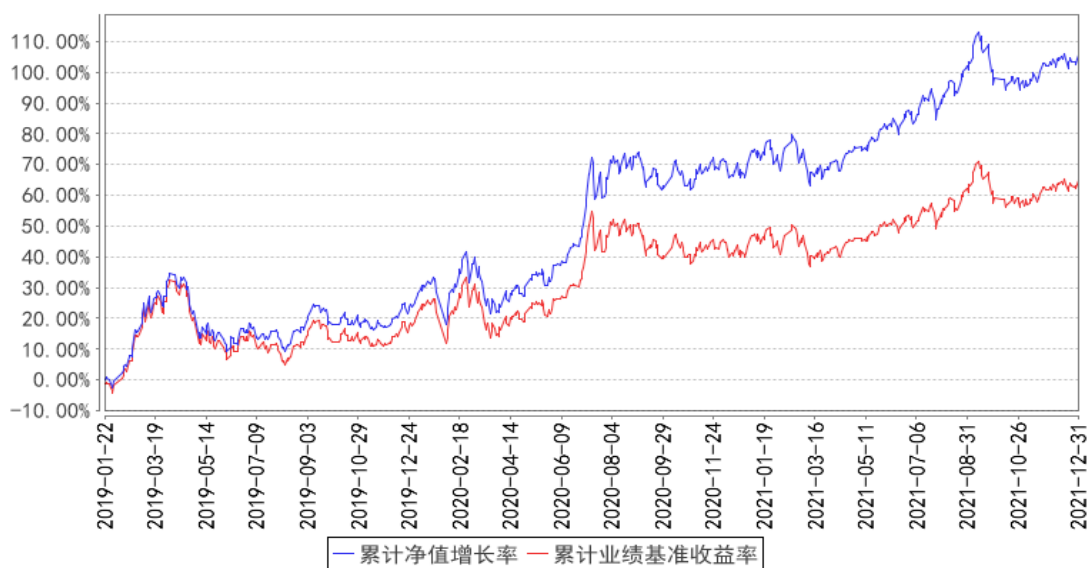
注：业绩比较基准=中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%

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



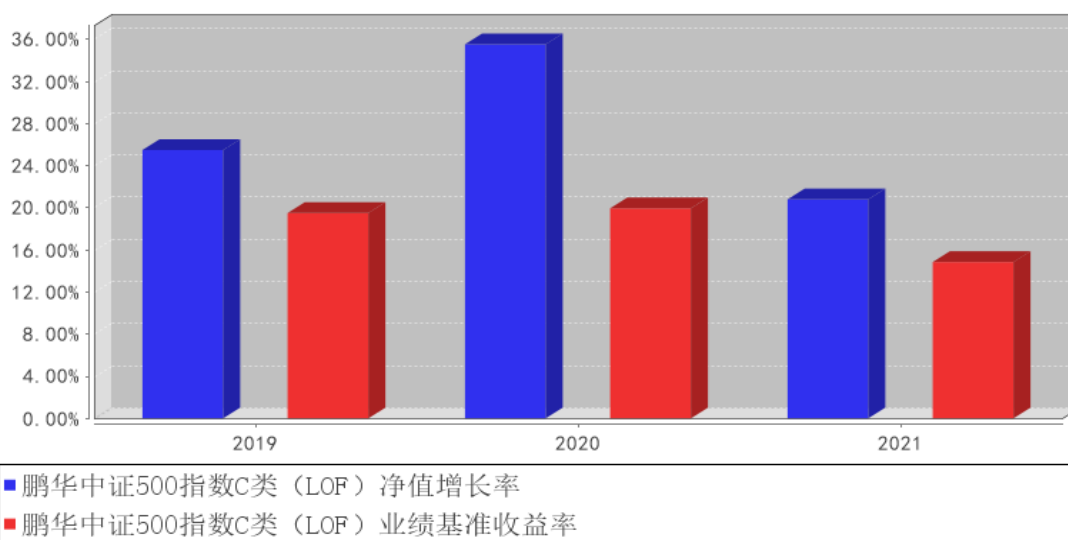
注：1、本基金基金合同于 2010 年 02 月 05 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.2.3 过去五年基金每年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）基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



鹏华中证500指数C类（LOF）基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

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 10,287.51 亿元, 管理 260 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

				<p>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 2021 年 10 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, 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 月担任鹏华国证钢铁行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传媒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 月担任鹏华中证高铁产业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 月担任鹏华中证移动互联网指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 07 月至今担任鹏华中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2021 年 08 月至今担任鹏华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2021 年 08 月至今担任鹏华中证医药卫生指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 12 月至今担任鹏华中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理,</p>
--	--	--	--	---

					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：本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、养老组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。在投资研究环节：1、公司使用唯一的研究报告发布平台“研究报告管理平台”，确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用债券投资与风险控制管理规定》，执行股票及信用产品出入库及日常维护工作，确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据；3、在公司股票库基础上，各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库，基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合；4、严格执行投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分，合理确定基金经理的投资权限，超过投资权限的操作，应严格履行审批程序。在交易执行环节：1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成，集中交易室负责建立和执行交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；2、针对交易所公开竞价交易，

集中交易室应严格启用恒生交易系统中的公平交易程序，交易系统则自动启用公平交易功能，由系统按照“未委托数量”的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配；如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易，且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时，交易系统自动按照“价格优先”原则进行委托；当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时，则交易系统自动按照“同一指令价格下的公平交易”模式，进行公平委托和交易量分配；3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行；银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行，对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。在交易监控、分析与评估环节：1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理，杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为，防范日常交易风险，公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制；所监控的交易包括但不限于：交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等；2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容，发现的异常情况由投资监察员进行分析；3、监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》，内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析；《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

4.3.2 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、分配各环节得到公平对待。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本报告期内 A 类份额净值增长率为 20.94%,同期业绩比较基准增长率为 14.85%,C 类份额净值增长率为 20.81%,同期业绩比较基准增长率为 14.85%。

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,是我国“十四五”规划开局之年,我国经济发展从高速度向高质量发展转变,在加快绿色、高技术产业等发展的同时,也加大了高能耗和房地产等行业管控,限制相关工业和投资表现。受到疫情带来的扰动,防控措施收紧等因素影响,服务类消费复苏仍较弱;同时,“芯片慌”也在一定程度上制约了汽车类消费,叠加上游原材料急升已传导至部分终端消费品,抑制全社会整体消费持续恢复。此外,疫情推动订单回流、海外生产需求则支撑外贸整体保持强劲表现。

展望 2022 年,我国政策主基调将以稳为主,预计疫情等所带来之不确定性因素在上半年仍将较大程度影响经济恢复。随着疫情进一步得到控制和结构性刺激政策陆续出台,预期下半年经济表现或将企稳回升。稳增长或成 2022 年中国宏观政策的重中之重。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,基金管理人继续完善内部控制、提升风险管理水平,着重开展了以下各项工作:

1、继续完善内部控制体系

公司根据法律法规、监管要求及业务发展需求,不断优化现有的标准化业务流程体系,强调业务流程服务于加强风险防范和提升运营效率,通过信息技术手段持续提升业务操作的系统化程度,并不断优化。

2、持续改进投资监控的方法与手段,保证基金投资业务的合法合规性

报告期内,在投资日常合规监控工作方面,公司根据法律法规和产品特点进一步完善了投资监控系统以提升投资监控效率;在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上,公司多次开展有关内幕交易、未公开信息等重要内容的合规培训,进一步强化全体投研人员的合规意识。

3、规范基金销售业务,保证基金销售业务的合法合规性

报告期内,在基金募集和持续营销活动中,公司严格规范基金销售业务,按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料,逐步落实反洗钱法律法规各

项要求, 并督促销售部门做好投资者教育工作, 本报告期内没有出现主动违规行为。

4、开展以风险为导向的内部稽核

报告期内, 监察稽核部开展了对信息技术管理、投资相关流程、员工行为、反洗钱业务、子公司管理和公司日常运作的定期监察稽核与专项监察稽核。监察稽核人员开展了以风险为导向的内部稽核, 通过稽核发现, 提高了公司标准化操作流程手册的执行效力, 优化了标准化操作流程手册。报告期内, 公司未发生重大风险事件。

4.7 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。

4.8 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 183, 739, 570. 95 元, 期末基金份额净值 1. 952 元; 鹏华中证 500 指数 C 类(LOF)期末可供分配利润为 60, 257, 087. 53 元, 期末基金份额净值 2. 055 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。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在本基金的投资运作、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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 24514 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“鹏华中证 500 指数基金 (LOF)”) 的财务报表, 包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表, 2021 年度的利润表和所有者权益 (基金净值) 变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会 (以下简称“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, 公允反映了鹏华中证 500 指数基金 (LOF) 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。

	<p>审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于鹏华中证 500 指数基金 (LOF)，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	无。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>鹏华中证 500 指数基金 (LOF) 的基金管理人鹏华基金管理有限公司 (以下简称“基金管理人”) 管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估鹏华中证 500 指数基金 (LOF) 的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项 (如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算鹏华中证 500 指数基金 (LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督鹏华中证 500 指数基金 (LOF) 的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对鹏华中证 500 指数基金 (LOF) 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提</p>

	<p>请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致鹏华中证 500 指数基金 (LOF) 不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报 (包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	仲文渊
会计师事务所的地址	中国上海市	
审计报告日期	2022 年 3 月 23 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	32,390,528.17	18,947,966.32
结算备付金		338,120.38	8,192.44
存出保证金		129,853.02	45,962.34
交易性金融资产	7.4.7.2	507,915,051.41	306,360,774.49
其中：股票投资		507,915,051.41	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	672,305.22
应收利息	7.4.7.5	3,296.19	1,818.19
应收股利		-	-
应收申购款		1,548,389.14	644,052.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		542,325,238.31	326,681,071.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,489,095.07	3,330,549.74
应付管理人报酬		290,884.12	203,461.55
应付托管费		58,176.83	40,692.33
应付销售服务费		13,754.13	6,306.87
应付交易费用	7.4.7.7	415,353.97	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	7.4.7.8	223,530.40	284,859.36
负债合计		2,490,794.52	4,015,221.27
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	272,359,058.06	198,691,003.01
未分配利润	7.4.7.10	267,475,385.73	123,974,847.21
所有者权益合计		539,834,443.79	322,665,850.22
负债和所有者权益总计		542,325,238.31	326,681,071.49

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额为 272,359,058.06 份，其中鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF) 基金份额总额为 192,963,543.71 份，基金份额净值 1.952 元；鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF) 基金份额总额为 79,395,514.35 份，基金份额净值 2.055 元。

7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		77,542,783.97	101,227,565.08
1. 利息收入		94,662.65	103,462.57
其中：存款利息收入	7.4.7.11	94,662.65	103,462.57
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)		85,332,853.42	71,030,336.51
其中: 股票投资收益	7.4.7.12	80,953,061.08	67,683,481.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	4,379,792.34	3,346,854.95
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-8,144,265.50	29,748,603.90
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.18	259,533.40	345,162.10
减: 二、费用		5,905,775.71	4,480,783.74
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,717,928.81	2,434,302.46
2. 托管费	7.4.10.2.2	543,585.74	486,860.48
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	82,135.13	68,653.39
4. 交易费用	7.4.7.19	2,131,415.03	1,060,334.41
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	7.4.7.20	430,711.00	430,633.00
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		71,637,008.26	96,746,781.34
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		71,637,008.26	96,746,781.34

7.3 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 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	-	71,637,008.26	71,637,008.26

动产生的基金净值变动数 (本期利润)			
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)	73,668,055.05	71,863,530.26	145,531,585.31
其中: 1. 基金申购款	516,628,135.72	450,951,824.27	967,579,959.99
2. 基金赎回款	-442,960,080.67	-379,088,294.01	-822,048,374.68
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)	272,359,058.06	267,475,385.73	539,834,443.79
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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)	-	96,746,781.34	96,746,781.34
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)	-71,609,338.35	-24,504,371.02	-96,113,709.37
其中: 1. 基金申购款	339,178,847.64	150,229,407.23	489,408,254.87
2. 基金赎回款	-410,788,185.99	-174,733,778.25	-585,521,964.24
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)	198,691,003.01	123,974,847.21	322,665,850.22
---------------------	----------------	----------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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%。

本财务报表由本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司于本基金的审计报告日批准报出。

7.4.2 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以

公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公

允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税(和/或)股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投

资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类/级别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的

经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号—收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	32,390,528.17	18,947,966.32
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	32,390,528.17	18,947,966.32

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	482,091,154.99	507,915,051.41	25,823,896.42
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	482,091,154.99	507,915,051.41	25,823,896.42
项目	上年度末		
	2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	272,392,612.57	306,360,774.49	33,968,161.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债	交易所市场	-	-

券	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		272,392,612.57	306,360,774.49	33,968,161.92

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	3,085.69	1,793.79
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	152.10	3.70
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	58.40	20.70
合计	3,296.19	1,818.19

7.4.7.6 其他资产

注：无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	415,353.97	149,351.42

银行间市场应付交易费用	-	-
合计	415,353.97	149,351.42

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,530.40	4,859.36
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	170,000.00	230,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	223,530.40	284,859.36

7.4.7.9 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 12 月 31 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	150,161,898.80	150,161,898.80
本期赎回 (以“-”号填列)	-134,050,229.90	-134,050,229.90
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	192,963,543.71	192,963,543.71

鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	366,466,236.92	366,466,236.92
本期赎回 (以“-”号填列)	-308,909,850.77	-308,909,850.77
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	79,395,514.35	79,395,514.35

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	72,474,526.51	-11,483,074.03	60,991,452.48
本期基金份额交易产生的变动数	21,646,422.35	-7,556,050.83	14,090,371.52
其中：基金申购款	184,462,999.87	-66,827,491.74	117,635,508.13
基金赎回款	-162,816,577.52	59,271,440.91	-103,545,136.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	276,853,890.73	-93,114,319.78	183,739,570.95

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	7,306,747.25	3,338,808.53	10,645,555.78
本期基金份额交易产生的变动数	45,552,236.07	12,220,922.67	57,773,158.74
其中：基金申购款	222,093,583.70	111,222,732.44	333,316,316.14
基金赎回款	-176,541,347.63	-99,001,809.77	-275,543,157.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,257,087.53	23,478,727.25	83,735,814.78

7.4.7.11 存款利息收入

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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	85,013.26	93,127.17
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	7,303.04	3,067.31
其他	2,346.35	7,268.09
合计	94,662.65	103,462.57

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

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	80,953,061.08	67,683,481.56
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	80,953,061.08	67,683,481.56

7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	655,760,607.97	361,685,546.10
减：卖出股票成本总额	574,807,546.89	294,002,064.54
买卖股票差价收入	80,953,061.08	67,683,481.56

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.16 股利收益

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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,379,792.34	3,346,854.95
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	4,379,792.34	3,346,854.95

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-8,144,265.50	29,748,603.90
股票投资	-8,144,265.50	29,748,603.90
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	-8,144,265.50	29,748,603.90

7.4.7.18 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	247,360.87	326,177.62
基金转换费收入	12,172.53	18,984.48
合计	259,533.40	345,162.10

7.4.7.19 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	2,131,415.03	1,060,334.41
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,131,415.03	1,060,334.41

7.4.7.20 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	711.00	633.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
合计	430,711.00	430,633.00

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(“Eurizon Capital SGR S.p.A.”)	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司(“鹏华资产”)	基金管理人的子公司

注：1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	296,984,151.41	20.89	224,660,536.35	37.33

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 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12月31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	276,098.25	21.09	41,736.85	10.05
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	207,981.46	37.53	51,124.71	34.23

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鹏华基金公司提供研究服务以及其他研究支持。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,717,928.81
其中：支付销售机构的客户维护费	856,766.78	713,795.71

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费	543,585.74

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累

计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

7.4.10.2.3 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12月31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	-	10,159.82	10,159.82
合计	-	10,159.82	10,159.82
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12月31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	-	17,741.35	17,741.35
合计	-	17,741.35	17,741.35

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	32,390,528.17	85,013.26	18,947,966.32	93,127.17

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 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12月31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	301091	深城交	网下申购	3,580	130,670.00
国信证券	301066	万事利	网下申购	3,436	18,004.64
国信证券	688622	禾信仪器	网下申购	1,204	21,310.80
国信证券	301032	新柴股份	网下申购	5,124	25,466.28
国信证券	688323	瑞华泰	网下申购	4,513	26,942.61
国信证券	300986	志特新材	网下申购	2,632	38,927.28
国信证券	300957	贝泰妮	网下申购	1,975	93,476.75
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月16日	锁定期股票	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	锁定期股票	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	锁定期股票	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	锁定期股票	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	锁定期股票	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	锁定期股票	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	锁定期股票	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	锁定期股票	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	锁定期股票	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	锁定期股票	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	锁定期股票	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	锁定期股票	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-

301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	锁定期股票	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	锁定期股票	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	锁定期股票	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	锁定期股票	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	锁定期股票	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	锁定期股票	6.96	12.51	1,569	10,920.24	19,628.19	-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	锁定期股票	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301045	天禄科技	2021年8月6日	2022年2月17日	锁定期股票	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	锁定期股票	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月28日	锁定期股票	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	锁定期股票	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	锁定期股票	60.64	234.74	167	10,126.88	39,201.58	-
301052	果麦文化	2021年8月23日	2022年2月28日	锁定期股票	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	锁定期股票	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301058	中粮工科	2021年9月	2022年3月	锁定期股票	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-

		1 日	9 日							
301062	上海艾录	2021 年 9 月 7 日	2022 年 3 月 14 日	锁定期股票	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021 年 9 月 9 日	2022 年 3 月 24 日	锁定期股票	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301066	万事利	2021 年 9 月 13 日	2022 年 3 月 22 日	锁定期股票	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	锁定期股票	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	锁定期股票	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 29 日	锁定期股票	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 30 日	锁定期股票	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 14 日	锁定期股票	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301089	拓新药业	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 27 日	锁定期股票	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301091	深城交	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 29 日	锁定期股票	36.50	31.31	358	13,067.00	11,208.98	-
301096	百诚医药	2021 年 12 月 13 日	2022 年 6 月 20 日	锁定期股票	79.60	78.53	123	9,790.80	9,659.19	-
301098	金埔园林	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 12 日	锁定期股票	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301100	风光股份	2021 年 12 月 10 日	2022 年 6 月 17 日	锁定期股票	27.81	31.14	434	12,069.54	13,514.76	-

301101	明月 镜片	2021 年 12 月 9 日	2022 年 6 月 16 日	锁定期 股票	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301108	洁雅 股份	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 6 日	锁定期 股票	57.27	53.71	174	9,964.98	9,345.54	-
301111	粤万 年青	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	锁定期 股票	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301118	恒光 股份	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 18 日	锁定期 股票	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301126	达嘉 维康	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	锁定期 股票	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301127	天源 环保	2021 年 12 月 23 日	2022 年 6 月 30 日	锁定期 股票	12.03	17.12	1,420	17,082.60	24,310.40	-
301133	金钟 股份	2021 年 11 月 19 日	2022 年 5 月 26 日	锁定期 股票	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301136	招标 股份	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股未 上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301138	华研 精机	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	锁定期 股票	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301155	海力 风电	2021 年 11 月 17 日	2022 年 5 月 24 日	锁定期 股票	60.66	96.75	305	18,501.30	29,508.75	-
301166	优宁 维	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	锁定期 股票	86.06	94.50	161	13,855.66	15,214.50	-
301168	通灵 股份	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 10 日	锁定期 股票	39.08	52.13	289	11,294.12	15,065.57	-

301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	锁定期股票	116.88	116.08	185	21,622.80	21,474.80	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	锁定期股票	43.99	50.77	211	9,281.89	10,712.47	-
301180	万祥科技	2021年11月9日	2022年5月16日	锁定期股票	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	锁定期股票	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	锁定期股票	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	锁定期股票	27.85	27.46	406	11,307.10	11,148.76	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	锁定期股票	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	锁定期股票	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月7日	锁定期股票	29.28	32.00	391	11,448.48	12,512.00	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	锁定期股票	69.89	88.72	212	14,816.68	18,808.64	-
601728	中国电信	2021年8月11日	2022年2月21日	锁定期股票	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688049	炬芯科技-U	2021年11月22日	2022年5月30日	锁定期股票	42.98	51.71	2,862	123,008.76	147,994.02	-
688262	国芯	2021	2022	新股未	41.98	41.98	3,925	164,771.50	164,771.50	-

	科技	年 12 月 28 日	年 1 月 6 日	上市						
688285	高铁电气	2021 年 10 月 12 日	2022 年 4 月 20 日	锁定期股票	7.18	9.14	15,159	108,841.62	138,553.26	-
688296	和达科技	2021 年 7 月 19 日	2022 年 1 月 27 日	锁定期股票	12.46	49.67	2,173	27,075.58	107,932.91	-
688501	青达环保	2021 年 7 月 9 日	2022 年 1 月 17 日	锁定期股票	10.57	21.11	1,759	18,592.63	37,132.49	-
688509	正元地信	2021 年 7 月 22 日	2022 年 2 月 7 日	锁定期股票	1.97	6.17	15,433	30,403.01	95,221.61	-
688511	天微电子	2021 年 7 月 22 日	2022 年 2 月 7 日	锁定期股票	28.09	54.52	1,490	41,854.10	81,234.80	-
688707	振华新材-U	2021 年 9 月 6 日	2022 年 3 月 14 日	锁定期股票	11.75	47.16	6,856	80,558.00	323,328.96	-
688711	宏微科技	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	锁定期股票	27.51	116.52	1,865	51,306.15	217,309.80	-

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。

7.4.12.2 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
002683	宏大爆破	2021年12月20日	重大事项	30.12	2022年1月4日	31.00	27,900	849,616.53	840,348.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务

的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在承受的范围之内。

7.4.13.2 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及其他具有基金托管资格的银行，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 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2020 年 12 月 31 日：未持有）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或于约定开放日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 12 月 31 日，本基金所持有的全部金融负债的合约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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	32,390,528.17	-	-	-	32,390,528.17
结算备付金	338,120.38	-	-	-	338,120.38
存出保证金	129,853.02	-	-	-	129,853.02
交易性金融资产	-	-	-	507,915,051.41	507,915,051.41
应收利息	-	-	-	3,296.19	3,296.19
应收申购款	-	-	-	1,548,389.14	1,548,389.14
资产总计	32,858,501.57	-	-	509,466,736.74	542,325,238.31
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,489,095.07	1,489,095.07

应付管理人报酬	-	-	-	290,884.12	290,884.12
应付托管费	-	-	-	58,176.83	58,176.83
应付销售服务费	-	-	-	13,754.13	13,754.13
应付交易费用	-	-	-	415,353.97	415,353.97
其他负债	-	-	-	223,530.40	223,530.40
负债总计	-	-	-	2,490,794.52	2,490,794.52
利率敏感度缺口	32,858,501.57	-	-	-506,975,942.22	539,834,443.79
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2021 年 12 月 31 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券，所面临的其他价格风险来源于标的指数成份券和备选成份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，按照个券在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	507,915,051.41	94.09	306,360,774.49	94.95
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	507,915,051.41	94.09	306,360,774.49	94.95

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

7.4.13.4.3.2 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12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	25,480,185.75	15,558,148.43
	业绩比较基准下降5%	-25,480,185.75	-15,558,148.43

注：无。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 503,229,429.26 元，属于第二层次的余额为 1,086,073.43 元，属于第三层次的余额为 3,599,548.72 元(2020 年 12 月 31 日：第一层次 301,572,242.01 元，第二层次 4,788,532.48 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易

不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具为人民币 3,599,548.72 元(2020 年 12 月 31 日:无),本基金本年度购买第三层次金融工具的金额为 2,650,497.14 元(2020 年度:无),无出售第三层次金融工具金额(2020 年度:无),无转入第三层次金融工具金额(2020 年度:无),无转出第三层次金融工具金额(2020 年度:无),计入损益的第三层次的金融工具公允价值变动或当期投资收益为 949,051.58 元(2020 年度:无)。

于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有第三层级的交易性金融资产(均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资)公允价值为 3,599,548.72 元,采用平均价格亚式期权模型进行估值,不可观察输入值为预期波动率,与公允价值之间为负相关关系。(2020 年 12 月 31 日:本基金未持有第三层级的交易性金融资产)。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日,本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质,新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初所有者权益,2021 年的比较数据将不作重述。

(3)除公允价值和执行新金融工具准则外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	507,915,051.41	93.66
	其中：股票	507,915,051.41	93.66
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	32,728,648.55	6.03
8	其他各项资产	1,681,538.35	0.31
9	合计	542,325,238.31	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	5,754,203.24	1.07
B	采矿业	19,754,596.34	3.66
C	制造业	298,293,520.46	55.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,852,768.20	3.68
E	建筑业	9,333,694.81	1.73
F	批发和零售业	16,120,555.13	2.99
G	交通运输、仓储和邮政业	12,330,326.46	2.28
H	住宿和餐饮业	3,114,722.00	0.58
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,002,858.52	7.78
J	金融业	37,615,174.10	6.97
K	房地产业	13,329,666.69	2.47
L	租赁和商务服务业	6,488,687.00	1.20
M	科学研究和技术服务业	1,662,991.00	0.31
N	水利、环境和公共	4,493,784.67	0.83

	设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,024,556.40	0.19
R	文化、体育和娱乐业	6,630,239.52	1.23
S	综合	3,525,506.52	0.65
	合计	501,327,851.06	92.87

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,750,365.75	0.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	262,014.02	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	25,722.00	0.00
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,288,964.89	0.42
J	金融业	69,749.68	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	824,518.27	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	303,354.03	0.06
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	46,383.72	0.01
S	综合	-	-
	合计	6,587,200.35	1.22

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

8.3 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

8.3.1 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	002340	格林美	325,515	3,369,080.25	0.62
2	600522	中天科技	181,700	3,081,632.00	0.57
3	601615	明阳智能	114,200	2,980,620.00	0.55
4	000723	美锦能源	173,100	2,809,413.00	0.52
5	600157	永泰能源	1,530,600	2,785,692.00	0.52
6	000733	振华科技	22,100	2,746,588.00	0.51
7	600399	抚顺特钢	106,100	2,628,097.00	0.49
8	000009	中国宝安	175,980	2,539,391.40	0.47
9	600884	杉杉股份	77,332	2,534,169.64	0.47
10	002384	东山精密	93,200	2,525,720.00	0.47
11	600885	宏发股份	32,780	2,446,699.20	0.45
12	002013	中航机电	131,800	2,396,124.00	0.44
13	002385	大北农	227,000	2,381,230.00	0.44
14	300285	国瓷材料	53,300	2,268,981.00	0.42
15	300088	长信科技	168,100	2,232,368.00	0.41
16	002268	卫士通	38,780	2,169,353.20	0.40
17	601555	东吴证券	241,680	2,141,284.80	0.40
18	300253	卫宁健康	126,600	2,121,816.00	0.39
19	601117	中国化学	176,000	2,112,000.00	0.39
20	600765	中航重机	41,595	2,100,131.55	0.39
21	688005	容百科技	18,116	2,093,847.28	0.39
22	300058	蓝色光标	194,300	2,084,839.00	0.39
23	600256	广汇能源	314,600	2,057,484.00	0.38
24	605358	立昂微	17,100	2,052,171.00	0.38
25	300751	迈为股份	3,100	1,991,130.00	0.37
26	300037	新宙邦	17,600	1,988,800.00	0.37
27	002180	纳思达	41,500	1,982,040.00	0.37
28	600754	锦江酒店	33,800	1,980,680.00	0.37
29	600862	中航高科	55,200	1,973,952.00	0.37
30	002185	华天科技	152,700	1,940,817.00	0.36
31	002028	思源电气	39,424	1,940,055.04	0.36
32	600298	安琪酵母	31,700	1,913,412.00	0.35
33	601168	西部矿业	140,200	1,908,122.00	0.35
34	600563	法拉电子	8,023	1,864,545.20	0.35
35	000988	华工科技	66,650	1,856,869.00	0.34
36	601636	旗滨集团	108,400	1,853,640.00	0.34
37	600392	盛和资源	94,329	1,850,734.98	0.34

38	002797	第一创业	251,300	1,839,516.00	0.34
39	300363	博腾股份	20,400	1,824,780.00	0.34
40	600141	兴发集团	47,718	1,807,557.84	0.33
41	000998	隆平高科	77,204	1,795,765.04	0.33
42	300136	信维通信	70,900	1,795,188.00	0.33
43	600418	江淮汽车	102,868	1,789,903.20	0.33
44	601077	渝农商行	464,900	1,789,865.00	0.33
45	002138	顺络电子	46,600	1,779,188.00	0.33
46	688099	晶晨股份	13,617	1,772,933.40	0.33
47	603456	九洲药业	31,500	1,772,190.00	0.33
48	000728	国元证券	228,900	1,762,530.00	0.33
49	000630	铜陵有色	506,300	1,761,924.00	0.33
50	300223	北京君正	13,100	1,755,400.00	0.33
51	000932	华菱钢铁	341,360	1,744,349.60	0.32
52	600875	东方电气	81,000	1,735,020.00	0.32
53	300308	中际旭创	40,200	1,708,500.00	0.32
54	600233	圆通速递	101,500	1,693,020.00	0.31
55	600516	方大炭素	155,600	1,683,592.00	0.31
56	002212	天融信	87,100	1,669,707.00	0.31
57	688002	睿创微纳	21,194	1,665,212.58	0.31
58	000519	中兵红箭	62,208	1,659,087.36	0.31
59	002353	杰瑞股份	41,400	1,656,000.00	0.31
60	688065	凯赛生物	8,974	1,653,728.72	0.31
61	002080	中材科技	48,200	1,639,764.00	0.30
62	300146	汤臣倍健	60,800	1,639,168.00	0.30
63	300418	昆仑万维	70,400	1,629,760.00	0.30
64	600038	中直股份	20,200	1,622,060.00	0.30
65	002673	西部证券	200,400	1,617,228.00	0.30
66	300699	光威复材	19,100	1,613,568.00	0.30
67	002223	鱼跃医疗	42,605	1,610,469.00	0.30
68	600486	扬农化工	12,200	1,600,640.00	0.30
69	603077	和邦生物	467,880	1,595,470.80	0.30
70	600733	北汽蓝谷	159,200	1,595,184.00	0.30
71	600705	中航产融	401,500	1,593,955.00	0.30
72	300724	捷佳伟创	13,900	1,588,770.00	0.29
73	603589	口子窖	22,400	1,587,488.00	0.29
74	601689	拓普集团	29,915	1,585,495.00	0.29
75	603613	国联股份	14,700	1,580,250.00	0.29
76	600482	中国动力	80,100	1,577,970.00	0.29
77	000547	航天发展	94,200	1,573,140.00	0.29
78	002409	雅克科技	19,300	1,566,581.00	0.29
79	000807	云铝股份	139,400	1,557,098.00	0.29

80	600487	亨通光电	102,700	1,552,824.00	0.29
81	000039	中集集团	90,320	1,549,891.20	0.29
82	000636	风华高科	52,000	1,549,600.00	0.29
83	300296	利亚德	151,000	1,547,750.00	0.29
84	600699	均胜电子	70,260	1,543,612.20	0.29
85	002439	启明星辰	53,900	1,537,767.00	0.28
86	688208	道通科技	19,266	1,529,720.40	0.28
87	600739	辽宁成大	78,300	1,528,416.00	0.28
88	002444	巨星科技	49,495	1,510,092.45	0.28
89	603267	鸿远电子	8,400	1,507,296.00	0.28
90	300474	景嘉微	9,900	1,506,780.00	0.28
91	600188	兖矿能源	64,000	1,505,920.00	0.28
92	603893	瑞芯微	11,000	1,505,900.00	0.28
93	002465	海格通信	137,300	1,499,316.00	0.28
94	002156	通富微电	76,600	1,488,338.00	0.28
95	600529	山东药玻	33,800	1,483,820.00	0.27
96	600988	赤峰黄金	99,000	1,475,100.00	0.27
97	000739	普洛药业	42,000	1,473,780.00	0.27
98	601016	节能风电	225,300	1,466,703.00	0.27
99	002030	达安基因	72,288	1,450,097.28	0.27
100	000738	航发控制	47,700	1,444,356.00	0.27
101	600637	东方明珠	152,300	1,439,235.00	0.27
102	002507	涪陵榨菜	38,000	1,436,400.00	0.27
103	600177	雅戈尔	208,100	1,433,809.00	0.27
104	002273	水晶光电	82,084	1,427,440.76	0.26
105	000960	锡业股份	72,900	1,423,737.00	0.26
106	600521	华海药业	65,600	1,420,896.00	0.26
107	601198	东兴证券	119,600	1,390,948.00	0.26
108	600549	厦门钨业	61,400	1,389,482.00	0.26
109	600704	物产中大	233,100	1,379,952.00	0.26
110	002078	太阳纸业	119,928	1,377,972.72	0.26
111	603605	珀莱雅	6,600	1,374,846.00	0.25
112	600732	爱旭股份	58,500	1,366,560.00	0.25
113	300383	光环新网	91,600	1,359,344.00	0.25
114	600201	生物股份	83,138	1,359,306.30	0.25
115	600859	王府井	50,049	1,351,323.00	0.25
116	601128	常熟银行	204,400	1,351,084.00	0.25
117	300763	锦浪科技	5,800	1,342,990.00	0.25
118	600642	申能股份	182,200	1,342,814.00	0.25
119	688521	芯原股份-U	17,330	1,340,648.80	0.25
120	600879	航天电子	162,100	1,335,704.00	0.25
121	600497	驰宏锌锗	267,200	1,333,328.00	0.25

122	002299	圣农发展	54,600	1,319,682.00	0.24
123	600369	西南证券	249,000	1,317,210.00	0.24
124	688536	思瑞浦	1,700	1,305,600.00	0.24
125	600027	华电国际	242,800	1,298,980.00	0.24
126	300357	我武生物	22,500	1,289,250.00	0.24
127	000830	鲁西化工	84,227	1,285,304.02	0.24
128	600160	巨化股份	99,480	1,284,286.80	0.24
129	300017	网宿科技	191,600	1,281,804.00	0.24
130	002092	中泰化学	133,968	1,278,054.72	0.24
131	600039	四川路桥	105,950	1,275,638.00	0.24
132	002739	万达电影	82,000	1,269,360.00	0.24
133	600803	新奥股份	69,100	1,268,676.00	0.24
134	000983	山西焦煤	152,390	1,260,265.30	0.23
135	603290	斯达半导	3,300	1,257,300.00	0.23
136	000027	深圳能源	154,800	1,253,880.00	0.23
137	000623	吉林敖东	67,800	1,252,266.00	0.23
138	002557	洽洽食品	20,400	1,251,744.00	0.23
139	600372	中航电子	55,900	1,251,601.00	0.23
140	000629	攀钢钒钛	321,500	1,250,635.00	0.23
141	002266	浙富控股	175,140	1,246,996.80	0.23
142	002131	利欧股份	506,540	1,246,088.40	0.23
143	601997	贵阳银行	191,300	1,245,363.00	0.23
144	002373	千方科技	82,114	1,227,604.30	0.23
145	002936	郑州银行	386,057	1,219,940.12	0.23
146	600580	卧龙电驱	66,586	1,217,857.94	0.23
147	002985	北摩高科	10,110	1,217,850.60	0.23
148	300115	长盈精密	61,302	1,216,231.68	0.23
149	603127	昭衍新药	10,500	1,212,015.00	0.22
150	600170	上海建工	332,300	1,196,280.00	0.22
151	002508	老板电器	33,200	1,195,864.00	0.22
152	600316	洪都航空	30,600	1,195,236.00	0.22
153	002249	大洋电机	135,750	1,193,242.50	0.22
154	300070	碧水源	165,800	1,192,102.00	0.22
155	000825	太钢不锈	169,200	1,191,168.00	0.22
156	002603	以岭药业	60,760	1,190,896.00	0.22
157	000050	深天马 A	91,400	1,190,028.00	0.22
158	600166	福田汽车	345,900	1,189,896.00	0.22
159	603444	吉比特	2,800	1,181,180.00	0.22
160	000750	国海证券	285,880	1,174,966.80	0.22
161	002422	科伦药业	61,900	1,171,767.00	0.22
162	002506	协鑫集成	307,100	1,166,980.00	0.22
163	000887	中鼎股份	53,100	1,158,111.00	0.21

164	600118	中国卫星	42,600	1,156,590.00	0.21
165	600867	通化东宝	105,400	1,155,184.00	0.21
166	600153	建发股份	127,300	1,154,611.00	0.21
167	300618	寒锐钴业	14,400	1,154,592.00	0.21
168	002926	华西证券	117,000	1,152,450.00	0.21
169	601778	晶科科技	134,300	1,145,579.00	0.21
170	600909	华安证券	211,350	1,143,403.50	0.21
171	300168	万达信息	87,300	1,136,646.00	0.21
172	600258	首旅酒店	43,400	1,134,042.00	0.21
173	600236	桂冠电力	175,900	1,129,278.00	0.21
174	002191	劲嘉股份	74,624	1,129,061.12	0.21
175	600008	首创环保	330,530	1,127,107.30	0.21
176	002002	鸿达兴业	185,738	1,125,572.28	0.21
177	603218	日月股份	34,100	1,123,595.00	0.21
178	000400	许继电气	43,000	1,122,300.00	0.21
179	002372	伟星新材	46,120	1,121,638.40	0.21
180	002065	东华软件	143,200	1,116,960.00	0.21
181	002056	横店东磁	59,008	1,113,480.96	0.21
182	002203	海亮股份	89,200	1,108,756.00	0.21
183	300009	安科生物	84,672	1,108,356.48	0.21
184	300001	特锐德	44,500	1,106,715.00	0.21
185	600271	航天信息	82,600	1,106,014.00	0.20
186	300251	光线传媒	86,000	1,105,100.00	0.20
187	603198	迎驾贡酒	15,900	1,104,255.00	0.20
188	600066	宇通客车	99,900	1,100,898.00	0.20
189	000975	银泰黄金	124,820	1,095,919.60	0.20
190	600517	国网英大	149,700	1,091,313.00	0.20
191	002408	齐翔腾达	103,913	1,091,086.50	0.20
192	002152	广电运通	91,400	1,087,660.00	0.20
193	600863	内蒙华电	275,700	1,086,258.00	0.20
194	000021	深科技	68,356	1,082,759.04	0.20
195	000997	新大陆	59,586	1,079,698.32	0.20
196	002221	东华能源	85,318	1,074,153.62	0.20
197	000656	金科股份	239,600	1,073,408.00	0.20
198	603707	健友股份	25,530	1,072,260.00	0.20
199	600171	上海贝岭	41,562	1,066,480.92	0.20
200	002500	山西证券	161,170	1,063,722.00	0.20
201	600535	天士力	66,500	1,054,025.00	0.20
202	601005	重庆钢铁	502,700	1,050,643.00	0.19
203	600348	华阳股份	88,400	1,047,540.00	0.19
204	603156	养元饮品	36,300	1,031,283.00	0.19
205	000513	丽珠集团	25,620	1,030,180.20	0.19

206	300024	机器人	92,100	1,028,757.00	0.19
207	300244	迪安诊断	30,520	1,024,556.40	0.19
208	600536	中国软件	20,500	1,023,565.00	0.19
209	002745	木林森	67,400	1,019,762.00	0.19
210	600998	九州通	69,200	1,018,624.00	0.19
211	000690	宝新能源	171,560	1,015,635.20	0.19
212	300026	红日药业	129,600	1,014,768.00	0.19
213	002127	南极电商	146,900	1,013,610.00	0.19
214	300630	普利制药	18,340	1,009,433.60	0.19
215	002572	索菲亚	45,400	1,007,880.00	0.19
216	002195	二三四五	430,621	1,007,653.14	0.19
217	000012	南玻A	101,238	1,005,293.34	0.19
218	000878	云南铜业	75,000	1,002,750.00	0.19
219	300315	掌趣科技	205,800	1,000,188.00	0.19
220	601872	招商轮船	243,300	997,530.00	0.18
221	600415	小商品城	204,700	992,795.00	0.18
222	601699	潞安环能	87,400	988,494.00	0.18
223	000970	中科三环	61,500	987,075.00	0.18
224	300212	易华录	27,920	986,972.00	0.18
225	600673	东阳光	111,049	986,115.12	0.18
226	002511	中顺洁柔	58,900	984,219.00	0.18
227	300182	捷成股份	152,800	967,224.00	0.18
228	600315	上海家化	23,913	966,324.33	0.18
229	002250	联化科技	53,649	964,072.53	0.18
230	600208	新湖中宝	322,000	959,560.00	0.18
231	000537	广宇发展	39,700	956,770.00	0.18
232	002019	亿帆医药	54,300	956,766.00	0.18
233	000999	华润三九	27,700	948,448.00	0.18
234	688006	杭可科技	8,740	940,249.20	0.17
235	603568	伟明环保	25,719	939,515.07	0.17
236	600801	华新水泥	48,630	938,559.00	0.17
237	000060	中金岭南	190,600	935,846.00	0.17
238	002153	石基信息	32,300	928,302.00	0.17
239	000401	冀东水泥	77,500	926,900.00	0.17
240	300463	迈克生物	31,600	922,404.00	0.17
241	601866	中远海发	281,200	913,900.00	0.17
242	600970	中材国际	79,750	911,542.50	0.17
243	603712	七一二	21,000	909,300.00	0.17
244	002505	鹏都农牧	237,970	909,045.40	0.17
245	000686	东北证券	103,500	908,730.00	0.17
246	300376	易事特	90,200	906,510.00	0.17
247	600155	华创阳安	90,100	897,396.00	0.17

248	000930	中粮科技	82,547	897,285.89	0.17
249	600380	健康元	69,848	896,848.32	0.17
250	600390	五矿资本	167,500	891,100.00	0.17
251	601992	金隅集团	312,900	888,636.00	0.16
252	600839	四川长虹	268,000	887,080.00	0.16
253	600667	太极实业	109,700	886,376.00	0.16
254	002831	裕同科技	26,260	884,699.40	0.16
255	002701	奥瑞金	125,953	881,671.00	0.16
256	600498	烽火通信	48,900	879,222.00	0.16
257	000729	燕京啤酒	103,800	879,186.00	0.16
258	600500	中化国际	102,600	878,256.00	0.16
259	600297	广汇汽车	328,600	877,362.00	0.16
260	002939	长城证券	67,700	876,715.00	0.16
261	600728	佳都科技	104,600	871,318.00	0.16
262	603858	步长制药	41,100	866,799.00	0.16
263	300482	万孚生物	21,950	864,391.00	0.16
264	002294	信立泰	31,400	857,848.00	0.16
265	600282	南钢股份	230,600	853,220.00	0.16
266	002004	华邦健康	117,535	850,953.40	0.16
267	601179	中国西电	152,200	844,710.00	0.16
268	600755	厦门国贸	116,913	842,942.73	0.16
269	600895	张江高科	55,900	841,854.00	0.16
270	600764	中国海防	20,700	841,662.00	0.16
271	002683	宏大爆破	27,900	840,348.00	0.16
272	002532	天山铝业	103,100	840,265.00	0.16
273	000598	兴蓉环境	132,800	839,296.00	0.16
274	002966	苏州银行	123,900	838,803.00	0.16
275	600158	中体产业	55,471	838,721.52	0.16
276	600511	国药股份	26,592	838,445.76	0.16
277	600718	东软集团	61,800	838,008.00	0.16
278	000540	中天金融	315,400	832,656.00	0.15
279	600216	浙江医药	48,700	831,796.00	0.15
280	002382	蓝帆医疗	51,000	830,790.00	0.15
281	002128	电投能源	55,700	827,145.00	0.15
282	603225	新凤鸣	55,620	825,957.00	0.15
283	002430	杭氧股份	27,500	825,275.00	0.15
284	300072	三聚环保	103,800	823,134.00	0.15
285	002670	国盛金控	85,620	821,952.00	0.15
286	002174	游族网络	53,600	816,864.00	0.15
287	002925	盈趣科技	23,840	811,275.20	0.15
288	600985	淮北矿业	72,200	807,196.00	0.15
289	002958	青农商行	208,000	802,880.00	0.15

290	600528	中铁工业	97,700	802,117.00	0.15
291	600567	山鹰国际	242,400	797,496.00	0.15
292	600409	三友化工	91,502	796,067.40	0.15
293	002010	传化智联	91,100	792,570.00	0.15
294	002368	太极股份	28,697	790,315.38	0.15
295	688029	南微医学	3,710	789,005.70	0.15
296	600827	百联股份	58,800	783,804.00	0.15
297	600566	济川药业	27,600	782,184.00	0.14
298	000709	河钢股份	316,900	779,574.00	0.14
299	000778	新兴铸管	179,700	778,101.00	0.14
300	002595	豪迈科技	28,000	777,280.00	0.14
301	600060	海信视像	57,400	772,030.00	0.14
302	603638	艾迪精密	24,120	769,910.40	0.14
303	601717	郑煤机	66,405	769,633.95	0.14
304	603866	桃李面包	27,092	769,412.80	0.14
305	002075	沙钢股份	131,700	767,811.00	0.14
306	002183	怡亚通	115,900	767,258.00	0.14
307	600782	新钢股份	145,300	767,184.00	0.14
308	600507	方大特钢	98,210	766,038.00	0.14
309	000581	威孚高科	35,500	764,670.00	0.14
310	603885	吉祥航空	43,000	763,250.00	0.14
311	002048	宁波华翔	35,272	762,933.36	0.14
312	000883	湖北能源	145,400	761,896.00	0.14
313	600598	北大荒	52,300	761,488.00	0.14
314	601456	国联证券	54,200	757,174.00	0.14
315	300271	华宇软件	59,600	756,920.00	0.14
316	002396	星网锐捷	32,100	756,597.00	0.14
317	600325	华发股份	125,575	755,961.50	0.14
318	600820	隧道股份	139,400	749,972.00	0.14
319	600737	中粮糖业	79,400	746,360.00	0.14
320	600967	内蒙一机	61,900	739,705.00	0.14
321	601880	辽港股份	424,722	734,769.06	0.14
322	600022	山东钢铁	410,250	734,347.50	0.14
323	600131	国网信通	33,200	725,420.00	0.13
324	600707	彩虹股份	106,200	724,284.00	0.13
325	000987	越秀金控	82,300	716,010.00	0.13
326	002690	美亚光电	19,100	715,486.00	0.13
327	600021	上海电力	55,500	711,510.00	0.13
328	601106	中国一重	204,400	711,312.00	0.13
329	000990	诚志股份	44,900	710,318.00	0.13
330	002124	天邦股份	110,080	708,915.20	0.13
331	002434	万里扬	47,900	706,046.00	0.13

332	600435	北方导航	65,972	704,580.96	0.13
333	601577	长沙银行	90,100	703,681.00	0.13
334	002146	荣盛发展	161,400	702,090.00	0.13
335	600663	陆家嘴	64,600	701,556.00	0.13
336	688188	柏楚电子	1,800	693,828.00	0.13
337	600572	康恩贝	138,477	692,385.00	0.13
338	002281	光迅科技	29,360	683,794.40	0.13
339	600446	金证股份	47,700	683,064.00	0.13
340	601118	海南橡胶	128,100	676,368.00	0.13
341	603883	老百姓	13,680	675,518.40	0.13
342	603927	中科软	24,680	675,244.80	0.13
343	000898	鞍钢股份	179,200	672,000.00	0.12
344	600811	东方集团	223,040	671,350.40	0.12
345	002390	信邦制药	90,000	667,800.00	0.12
346	688088	虹软科技	15,043	662,794.58	0.12
347	000488	晨鸣纸业	90,859	657,819.16	0.12
348	600808	马钢股份	178,100	657,189.00	0.12
349	002429	兆驰股份	135,200	657,072.00	0.12
350	002440	闰土股份	68,211	654,143.49	0.12
351	600597	光明乳业	44,600	647,592.00	0.12
352	002233	塔牌集团	60,952	644,872.16	0.12
353	300166	东方国信	59,119	638,485.20	0.12
354	002155	湖南黄金	61,400	636,104.00	0.12
355	600299	安迪苏	51,600	635,712.00	0.12
356	002423	中粮资本	77,900	630,990.00	0.12
357	002416	爱施德	55,400	630,452.00	0.12
358	000877	天山股份	41,048	628,444.88	0.12
359	600908	无锡银行	110,500	626,535.00	0.12
360	000559	万向钱潮	98,300	626,171.00	0.12
361	002085	万丰奥威	114,000	625,860.00	0.12
362	600037	歌华有线	71,500	620,620.00	0.11
363	002110	三钢闽光	90,700	616,760.00	0.11
364	600398	海澜之家	96,100	616,001.00	0.11
365	600546	山煤国际	74,700	613,287.00	0.11
366	600329	中新药业	19,462	611,301.42	0.11
367	601200	上海环境	48,520	610,866.80	0.11
368	601000	唐山港	221,698	609,669.50	0.11
369	600026	中远海能	102,956	609,499.52	0.11
370	688321	微芯生物	17,286	605,182.86	0.11
371	002081	金螳螂	99,100	602,528.00	0.11
372	601991	大唐发电	185,300	600,372.00	0.11
373	600064	南京高科	63,522	593,295.48	0.11

374	600906	财达证券	46,400	592,064.00	0.11
375	001914	招商积余	29,200	591,592.00	0.11
376	603228	景旺电子	17,088	590,048.64	0.11
377	600373	中文传媒	47,700	589,572.00	0.11
378	000961	中南建设	142,400	589,536.00	0.11
379	000528	柳工	76,380	588,889.80	0.11
380	601718	际华集团	197,600	588,848.00	0.11
381	603650	彤程新材	11,700	588,744.00	0.11
382	600195	中牧股份	44,971	587,770.97	0.11
383	600259	广晟有色	11,931	587,482.44	0.11
384	000685	中山公用	65,574	580,329.90	0.11
385	000158	常山北明	83,500	577,820.00	0.11
386	600167	联美控股	63,980	576,459.80	0.11
387	601608	中信重工	128,800	574,448.00	0.11
388	300133	华策影视	84,500	572,065.00	0.11
389	000090	天健集团	97,213	570,640.31	0.11
390	600120	浙江东方	128,990	570,135.80	0.11
391	601333	广深铁路	254,400	569,856.00	0.11
392	002387	维信诺	61,400	569,792.00	0.11
393	002038	双鹭药业	52,700	569,687.00	0.11
394	300869	康泰医学	14,000	567,700.00	0.11
395	000959	首钢股份	99,000	567,270.00	0.11
396	601611	中国核建	56,500	563,305.00	0.10
397	002705	新宝股份	22,600	558,220.00	0.10
398	603000	人民网	38,700	558,054.00	0.10
399	000758	中色股份	101,900	556,374.00	0.10
400	002867	周大生	31,050	552,069.00	0.10
401	000089	深圳机场	75,400	551,928.00	0.10
402	600582	天地科技	123,245	539,813.10	0.10
403	000671	阳光城	178,600	539,372.00	0.10
404	600376	首开股份	95,200	538,832.00	0.10
405	000415	渤海租赁	184,300	536,313.00	0.10
406	000718	苏宁环球	112,400	529,404.00	0.10
407	601598	中国外运	117,000	524,160.00	0.10
408	601975	招商南油	259,800	522,198.00	0.10
409	600126	杭钢股份	100,600	516,078.00	0.10
410	600307	酒钢宏兴	232,900	512,380.00	0.09
411	603317	天味食品	18,980	508,853.80	0.09
412	000967	盈峰环境	68,800	504,304.00	0.09
413	600062	华润双鹤	37,512	501,535.44	0.09
414	000402	金融街	87,800	496,948.00	0.09
415	601098	中南传媒	51,800	495,726.00	0.09

416	688289	圣湘生物	8,383	494,597.00	0.09
417	600959	江苏有线	149,800	492,842.00	0.09
418	001965	招商公路	64,200	492,414.00	0.09
419	002458	益生股份	43,500	491,985.00	0.09
420	003022	联泓新科	13,400	488,296.00	0.09
421	600643	爱建集团	71,772	485,178.72	0.09
422	601958	金钼股份	70,500	482,925.00	0.09
423	000563	陕国投 A	148,432	479,435.36	0.09
424	002242	九阳股份	20,641	478,871.20	0.09
425	600556	天下秀	37,100	458,185.00	0.08
426	600056	中国医药	38,794	458,157.14	0.08
427	601156	东航物流	20,900	457,292.00	0.08
428	002563	森马服饰	59,000	456,070.00	0.08
429	600095	湘财股份	45,000	455,400.00	0.08
430	002399	海普瑞	26,500	453,150.00	0.08
431	300257	开山股份	28,500	452,580.00	0.08
432	600901	江苏租赁	88,900	452,501.00	0.08
433	003035	南网能源	54,400	450,976.00	0.08
434	600266	城建发展	99,828	449,226.00	0.08
435	601928	凤凰传媒	55,500	448,995.00	0.08
436	600717	天津港	107,038	448,489.22	0.08
437	600968	海油发展	151,200	443,016.00	0.08
438	601860	紫金银行	130,600	437,510.00	0.08
439	000937	冀中能源	78,000	429,780.00	0.08
440	002244	滨江集团	91,992	428,682.72	0.08
441	600928	西安银行	99,300	426,990.00	0.08
442	001203	大中矿业	28,000	422,240.00	0.08
443	000717	韶钢松山	88,200	418,950.00	0.08
444	002815	崇达技术	24,200	407,770.00	0.08
445	600787	中储股份	64,634	403,316.16	0.07
446	002468	申通快递	44,000	399,960.00	0.07
447	600006	东风汽车	58,443	397,996.83	0.07
448	600776	东方通信	33,500	385,585.00	0.07
449	600339	中油工程	124,400	383,152.00	0.07
450	600649	城投控股	93,200	383,052.00	0.07
451	300741	华宝股份	8,000	382,800.00	0.07
452	000062	深圳华强	21,860	376,647.80	0.07
453	600623	华谊集团	40,900	372,190.00	0.07
454	000028	国药一致	10,057	371,907.86	0.07
455	002424	贵州百灵	48,800	370,880.00	0.07
456	601665	齐鲁银行	65,900	367,722.00	0.07
457	601139	深圳燃气	41,600	367,328.00	0.07

458	002375	亚厦股份	48,700	364,763.00	0.07
459	600835	上海机电	22,446	357,340.32	0.07
460	600729	重庆百货	13,571	353,117.42	0.07
461	000031	大悦城	94,483	352,421.59	0.07
462	600648	外高桥	26,600	351,918.00	0.07
463	000156	华数传媒	40,600	343,476.00	0.06
464	601969	海南矿业	28,300	339,883.00	0.06
465	002653	海思科	16,600	338,640.00	0.06
466	600871	石化油服	152,700	326,778.00	0.06
467	600377	宁沪高速	36,500	314,630.00	0.06
468	601228	广州港	92,700	308,691.00	0.06
469	000046	泛海控股	162,300	305,124.00	0.06
470	600639	浦东金桥	23,800	303,926.00	0.06
471	601828	美凯龙	34,200	301,302.00	0.06
472	002302	西部建设	36,500	293,095.00	0.05
473	601298	青岛港	50,800	289,052.00	0.05
474	000869	张裕 A	9,000	286,740.00	0.05
475	603708	家家悦	17,100	284,544.00	0.05
476	002948	青岛银行	60,800	281,504.00	0.05
477	603379	三美股份	12,000	273,360.00	0.05
478	600823	世茂股份	82,700	271,256.00	0.05
479	000553	安道麦 A	31,300	264,172.00	0.05
480	001872	招商港口	15,500	262,725.00	0.05
481	601869	长飞光纤	8,000	261,920.00	0.05
482	002945	华林证券	18,400	251,344.00	0.05
483	603719	良品铺子	5,800	246,326.00	0.05
484	600350	山东高速	46,500	239,940.00	0.04
485	600657	信达地产	62,500	233,125.00	0.04
486	601568	北元集团	27,900	226,827.00	0.04
487	603786	科博达	2,800	224,840.00	0.04
488	603056	德邦股份	21,900	224,037.00	0.04
489	603355	莱克电气	7,580	222,245.60	0.04
490	603515	欧普照明	10,000	207,600.00	0.04
491	600466	蓝光发展	100,560	205,142.40	0.04
492	601003	柳钢股份	37,400	195,228.00	0.04
493	002946	新乳业	11,800	188,092.00	0.03
494	600917	重庆燃气	21,600	181,224.00	0.03
495	600956	新天绿能	9,400	161,774.00	0.03
496	600903	贵州燃气	15,700	151,976.00	0.03
497	601187	厦门银行	20,800	143,520.00	0.03
498	002901	大博医疗	2,800	141,736.00	0.03
499	603868	飞科电器	3,100	134,602.00	0.02

500	603983	丸美股份	3,400	108,358.00	0.02
501	601068	中铝国际	16,500	100,650.00	0.02

8.3.2 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	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.31
2	688131	皓元医药	1,877	466,772.36	0.09
3	688707	振华新材-U	6,856	323,328.96	0.06
4	301127	天源环保	14,196	282,002.32	0.05
5	688167	炬光科技	1,208	264,552.00	0.05
6	688711	宏微科技	1,865	217,309.80	0.04
7	688425	铁建重工	35,753	181,267.71	0.03
8	688601	力芯微	1,174	178,213.20	0.03
9	301168	通灵股份	2,887	171,101.45	0.03
10	688262	国芯科技	3,925	164,771.50	0.03
11	301166	优宁维	1,601	163,534.50	0.03
12	688206	概伦电子	4,320	158,500.80	0.03
13	688049	炬芯科技-U	2,862	147,994.02	0.03
14	688161	威高骨科	2,308	147,065.76	0.03
15	688285	高铁电气	15,159	138,553.26	0.03
16	688227	品高股份	4,164	133,581.12	0.02
17	688265	南模生物	1,741	121,957.05	0.02
18	301190	善水科技	4,052	121,257.96	0.02
19	688296	和达科技	2,173	107,932.91	0.02
20	301108	洁雅股份	1,736	103,331.08	0.02
21	301182	凯旺科技	2,932	103,061.60	0.02
22	688509	正元地信	15,433	95,221.61	0.02
23	688511	天微电子	1,490	81,234.80	0.02
24	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.01
25	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.01
26	301029	怡合达	462	41,519.94	0.01
27	603071	物产环能	1,627	41,098.02	0.01
28	301050	雷电微力	167	39,201.58	0.01
29	688501	青达环保	1,759	37,132.49	0.01
30	301155	海力风电	305	29,508.75	0.01
31	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.01
32	001317	三羊马	300	25,722.00	0.00
33	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
34	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
35	301177	迪阿股份	185	21,474.80	0.00
36	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00

37	301039	中集车辆	1,569	19,628.19	0.00
38	603216	梦天家居	772	19,523.88	0.00
39	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
40	301221	光庭信息	212	18,808.64	0.00
41	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
42	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
43	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
44	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
45	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
46	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
47	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
48	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
49	301100	风光股份	434	13,514.76	0.00
50	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
51	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
52	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
53	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
54	301199	迈赫股份	391	12,512.00	0.00
55	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
56	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
57	301091	深城交	358	11,208.98	0.00
58	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
59	301179	泽宇智能	211	10,712.47	0.00
60	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
61	301096	百诚医药	123	9,659.19	0.00
62	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
63	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
64	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
65	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
66	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
67	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
68	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
69	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
70	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
71	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
72	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
73	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
74	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
75	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
76	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
77	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
78	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
79	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00

80	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
81	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
82	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
83	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
84	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
85	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
86	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
87	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
88	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
89	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
90	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	5,895,900.00	1.83
2	600089	特变电工	5,499,212.81	1.70
3	002340	格林美	5,457,707.00	1.69
4	002709	天赐材料	5,105,547.20	1.58
5	002074	国轩高科	4,268,132.12	1.32
6	000009	中国宝安	4,233,179.07	1.31
7	601636	旗滨集团	3,720,666.00	1.15
8	300285	国瓷材料	3,630,599.69	1.13
9	601615	明阳智能	3,591,550.00	1.11
10	300037	新宙邦	3,582,905.00	1.11
11	600460	士兰微	3,572,203.00	1.11
12	601233	桐昆股份	3,507,360.00	1.09
13	300253	卫宁健康	3,447,043.00	1.07
14	300207	欣旺达	3,211,825.00	1.00
15	600522	中天科技	3,192,764.96	0.99
16	000723	美锦能源	3,143,277.00	0.97
17	600885	宏发股份	3,091,721.00	0.96
18	600884	杉杉股份	3,086,038.00	0.96
19	002185	华天科技	3,062,538.00	0.95
20	600733	北汽蓝谷	3,023,593.00	0.94

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。

8.4.2 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	600089	特变电工	10,004,644.99	3.10
2	002709	天赐材料	8,984,919.38	2.78

3	002074	国轩高科	7,492,183.00	2.32
4	300274	阳光电源	7,199,770.97	2.23
5	600460	士兰微	6,412,334.02	1.99
6	300207	欣旺达	6,135,582.00	1.90
7	000799	酒鬼酒	5,808,661.00	1.80
8	300316	晶盛机电	5,573,777.34	1.73
9	601233	桐昆股份	5,127,932.14	1.59
10	603486	科沃斯	5,060,220.04	1.57
11	600219	南山铝业	4,769,251.09	1.48
12	002340	格林美	4,291,723.00	1.33
13	300012	华测检测	4,000,165.09	1.24
14	002625	光启技术	3,941,935.39	1.22
15	002568	百润股份	3,825,557.60	1.19
16	000009	中国宝安	3,732,487.00	1.16
17	600426	华鲁恒升	3,640,653.66	1.13
18	002648	卫星化学	3,554,421.40	1.10
19	300146	汤臣倍健	3,337,599.64	1.03
20	601099	太平洋	3,321,240.00	1.03

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。

8.4.3 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	784,506,089.31
卖出股票收入（成交）总额	655,760,607.97

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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

8.12.3 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	129,853.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,296.19
5	应收申购款	1,548,389.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,681,538.35

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

8.12.5.2 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	601728	中国电信	1,682,426.97	0.31	锁定期股票
2	688707	振华新材-U	323,328.96	0.06	锁定期股票
3	301127	天源环保	24,310.40	0.00	锁定期股票

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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)	46,379	4,160.58	148,530.60	0.08	192,815,013.11	99.92
鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)	1,264	62,812.91	58,496,091.21	73.68	20,899,423.14	26.32
合计	47,643	5,716.66	58,644,621.81	21.53	213,714,436.25	78.47

9.2 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	6.77
2	张宏旭	200,012.00	3.16
3	施红梅	197,014.00	3.11
4	陈吉荃	150,042.00	2.37
5	张宇	133,500.00	2.11

6	鹿敏理	119,003.00	1.88
7	俞富良	117,026.00	1.85
8	于兆瑞	107,360.00	1.70
9	赵丽丽	100,017.00	1.58
10	余广述	100,015.00	1.58

注：持有人为场内持有人。

9.3 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)	22,454.68	0.0116
	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)	75,451.25	0.0950
	合计	97,905.93	0.0359

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。

9.4 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。

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：无。

§ 10 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	150,161,898.80	366,466,236.92
减：本报告期基金总赎回份额	134,050,229.90	308,909,850.77
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以	-	-

“-” 填列)		
本报告期末基金份额总额	192,963,543.71	79,395,514.35

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

报告期内，公司原副总经理苏波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 7 月 24 日离任。

报告期内，经公司董事会审议通过，聘任李伟先生担任公司副总经理，任职日期自 2021 年 7 月 24 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 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。本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元，该审计机构已提供审计服务的年限为 12 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
银河证券	1	415,769,734.22	29.25%	387,183.89	29.58%	-
长江证券	1	365,762,750.87	25.73%	333,330.56	25.46%	-
广发证券	1	342,937,843.48	24.13%	312,529.47	23.87%	-
国信证券	2	296,984,151.41	20.89%	276,098.25	21.09%	-

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。

11.7.2 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
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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 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基金电子披露网站	2021 年 03 月 30 日
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	2021 年 04 月 10 日

		理人网站及中国证监会 基金电子披露网站	
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	2021 年 06 月 04 日

		基金电子披露网站	
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司申购及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 07 月 01 日
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国人寿保险股份有限公司申购 (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 07 月 01 日
38	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 07 月 12 日
39	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安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 07 月 16 日
40	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购新柴股份首次公开发行 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 07 月 17 日
41	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2021 年第 2 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 07 月 20 日
42	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 07 月 24 日
43	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 07 月 24 日
44	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 07 月 29 日
45	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华融证券股份有限公司申购 (含定期定额申购) 费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 07 月 31 日
46	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与招商证券股份有限公司申购 (含定期定额申购) 费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 07 月 31 日
47	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与申万宏源证券有限公司申购 (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 08 月 12 日
48	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分	《中国证券报》、基金管	2021 年 08 月 12 日

	基金参与申万宏源西部证券有限公司申购 (含定期定额申购) 费率优惠活动的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
49	鹏华基金管理有限公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告	《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 08 月 21 日
50	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 08 月 25 日
51	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华宝证券股份有限公司认\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 08 月 27 日
52	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2021 年中期报告	《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 08 月 30 日
53	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购禾信仪器首次公开发行 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 09 月 04 日
54	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国建设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 09 月 06 日
55	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与新时代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 09 月 10 日
56	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购万事利首次公开发行 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 09 月 15 日
57	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与江苏银行股份有限公司认购、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 09 月 17 日
58	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与江苏银行股份有限公司认购、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 09 月 17 日
59	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与江海证券有限公司申购 (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 09 月 22 日
60	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与部分销售机构申购 (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 09 月 29 日
61	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分	《中国证券报》、基金管	2021 年 10 月 22 日

	基金申购深城交首次公开发行 A 股的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
62	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2021 年第 3 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 10 月 26 日
63	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	《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 10 月 30 日
64	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与新时代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 11 月 10 日
65	鹏华基金管理有限公司关于终止晋城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 11 月 12 日
66	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与西部证券股份有限公司申购 (不含定期定额申购) 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 11 月 18 日
67	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	《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 11 月 26 日
68	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安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 11 月 26 日
69	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《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 12 月 04 日
70	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《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 12 月 11 日
71	鹏华基金管理有限公司关于新增人民币直销资金专户的公告	《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 12 月 27 日
72	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国中金财富证券有限公司申购 (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 12 月 29 日
73	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司“2022 倾心回馈”基金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 12 月 31 日

注：无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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 年年度报告》(原文)。

13.2 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。

13.3 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

2022 年 3 月 30 日