

鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资
基金
2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	62
7.1 期末基金资产组合情况	62
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	62
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	64
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	77
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	78

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	78
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	78
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	78
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	78
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	78
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	79
7.12 投资组合报告附注	79
§ 8 基金份额持有人信息	80
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	80
8.2 期末上市基金前十名持有人	81
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	81
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	81
§ 9 开放式基金份额变动	81
§ 10 重大事件揭示	82
10.1 基金份额持有人大会决议	82
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	82
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	82
10.4 基金投资策略的改变	82
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	82
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	82
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	82
10.8 其他重大事件	83
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	84
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	84
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	85
§ 12 备查文件目录	85
12.1 备查文件目录	85
12.2 存放地点	85
12.3 查阅方式	85

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证 500
场内简称	中证 500ETF 鹏华
基金主代码	159982
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 11 月 21 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	250,211,253.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易 所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 2 月 20 日

注：无。

2.2 基金产品说明

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

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

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	高永杰	郭明
	联系电话	0755-81395402	010-66105799
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105798
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		何如	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-3,761,457.27
本期利润	-40,920,726.97
加权平均基金份额本期利润	-0.1628
本期加权平均净值利润率	-11.11%
本期基金份额净值增长率	-10.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	126,790,224.20
期末可供分配基金份额利润	0.5067
期末基金资产净值	377,001,477.20
期末基金份额净值	1.5067
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	50.67%

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）

扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

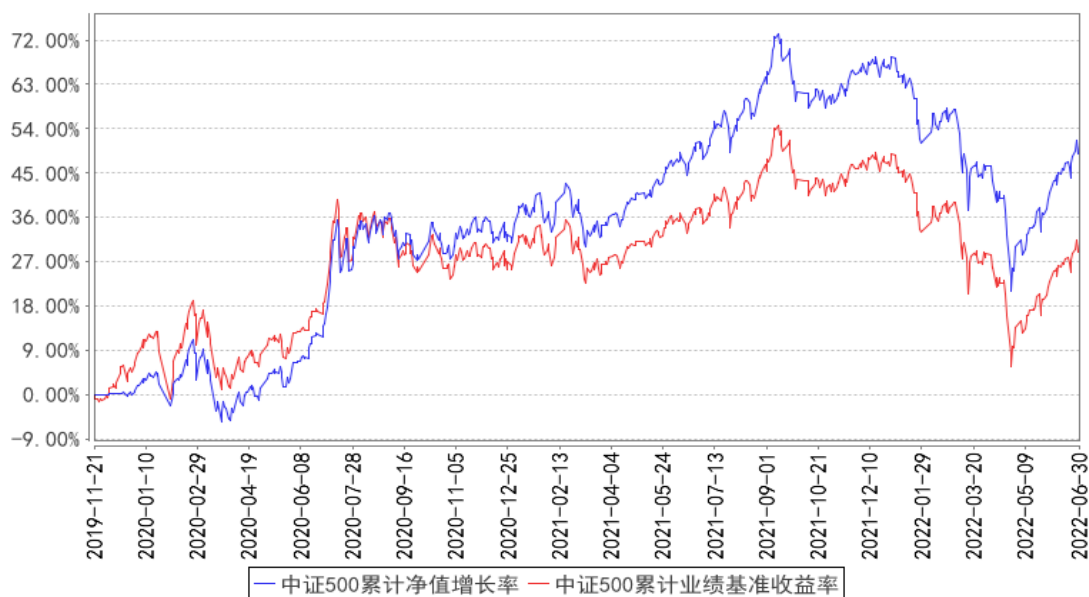
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.95%	1.08%	7.10%	1.10%	0.85%	-0.02%
过去三个月	3.45%	1.71%	2.04%	1.75%	1.41%	-0.04%
过去六个月	-10.62%	1.60%	-12.30%	1.63%	1.68%	-0.03%
过去一年	-0.35%	1.30%	-5.20%	1.33%	4.85%	-0.03%
自基金合同生效起至今	50.67%	1.29%	30.48%	1.38%	20.19%	-0.09%

注：业绩比较基准=中证 500 指数收益率

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中证500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 2019 年 11 月 21 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模达到 11946.65 亿元，267 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 多年投资管理基金，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		
陈龙	基金经理	2019-11-21	-	13 年	陈龙先生，国籍中国，经济学硕士，13 年证券从业经验。曾任杭州衡泰软件公司金

					融工程师，2009 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部金融工程总监助理、量化及衍生品投资部量化研究总监助理，先后从事金融工程、量化研究等工作，现任量化及衍生品投资部量化研究副总经理、基金经理。2015 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 07 月至 2018 年 04 月担任鹏华创业板指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 04 月担任鹏华中证 800 地产指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华港股通中证香港中小企业投资主题指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 04 月担任鹏华中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至今担任鹏华中证空天一体军工指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 11 月至今担任鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019 年 12 月至今担任鹏华国证证券龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 01 月至今担任鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2021 年 01 月至今担任鹏华中证 800 证券保险指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2021 年 01 月至今担任鹏华中证全指证券公司指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2021 年 01 月至今担任鹏华中证国防指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2021 年 02 月至今担任鹏华中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金基金经理，陈龙先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
--	--	--	--	--	---

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，因市场波动等被动原因存在本基金投资比例不符合基金合同要求的情形，本基金管理人严格按照基金合同的约定及时进行了调整，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为-10.62%，同期业绩比较基准增长率为-12.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年上半年，国内宏观经济以稳为主，政策层面上把稳增长摆在相对突出的位置。期间经历了两次黑天鹅事件的冲击：一是三月初的俄乌冲突，带动大宗商品价格快速上涨，大幅侵蚀了中游制造业的利润；二是 4 月份上海疫情的扩散，给全国的物流、航运及高端制造产业带来较为严重的冲击。

4 月底是全年的重要拐点。随着上海疫情防控形势的显著好转，政治局会议强调“疫情要防住、经济要稳住、发展要安全”，政策开始在疫情防控和稳增长之间取得平衡。5 月份以来，随着系列稳增长、促消费政策落地，经济环比显著修复，出口仍然维持强劲，汽车销量显著回暖，30

城的房地产销售数据也显著改善。

上半年，A 股市场也跟随国内的宏观经济经历了一波三折。年初以来至 2 月份，受稳增长政策的驱动，以及美联储加息、缩表的影响，以房地产、基建为代表的稳增长的方向经历了一波显著估值修复行情；之后 3-4 月份，市场遭受了系统性的波动，景气成长方向大幅杀跌，市场陷入了一种极端恐慌状态；而 5 月份以来，随着政策开始纠偏，市场信心开始修复，一季报以及高频数据持续验证光伏、新能源车以及国防军工等行业的景气度，景气成长方向也迎来了一轮 V 型修复行情，部分强势行业甚至一度修复年初以来的跌幅。

展望 2022 年下半年，宏观方面，随着稳增长政策的持续落地，经济、金融数据有望延续环比修复的趋势，至少在三季度上半段，我们认为这样的趋势还是可以延续的。后面随着政策效果的边际递减，叠加海外因为持续高通胀而采取激进加息策略，使得发达经济体也逐步步入衰退的节奏，也可能会给国内的出口带来的较大的压力。预计从 8 月开始，经济稳增长的压力将会显著增大，叠加国内零星多点的疫情反复，也注定的下半年的经济修复不会一帆风顺。

权益市场方面，7 月份以来，明显能够感觉到市场的波动在加大，进一步上行的难度显著增加。我们认为市场进一步上行的动力主要来自于两个方面：一是经济超预期修复，可以紧密跟踪社融数据中的重要分项——中长期贷款；二是近期市场赚钱效应刺激场外增量资金入场，可以关注偏股型基金发行回暖的情况。而下行的风险则主要来自经济修复动能的减弱，同时关注科创板解禁、美联储快速、大幅加息，以及猪价带动的国内自身通胀的快速上行。

行业配置方面，建议关注三个方面的思路：一是景气成长方向中，重点关注需求来自政府的方向，比如光伏、国防军工等，受宏观经济波动相对较小；二是受益于政策刺激及疫后复苏的消费方向，包括白酒、汽车及家电等可选消费；三是困境反转的方向，比如畜牧养殖、个别医药细分行业等。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 126,790,224.20 元，期末基金份额净值 1.5067 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	10,108,933.33	9,693,729.64
结算备付金		9,170,759.81	10,374,271.32
存出保证金		1,817,411.24	2,124,606.75
交易性金融资产	6.4.7.2	356,256,154.95	369,701,845.73
其中：股票投资		356,256,154.95	369,701,845.73
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		227,986.15	-
应收股利		66,073.16	280.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	9,518.14	16,390.74
资产总计		377,656,836.78	391,911,124.18
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		-	-
应付清算款		10,352.81	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		45,459.31	50,651.98
应付托管费		15,153.07	16,883.98
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,843.52	7,672.16

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	582,550.87	405,060.61
负债合计		655,359.58	480,268.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	250,211,253.00	232,211,253.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	126,790,224.20	159,219,602.45
净资产合计		377,001,477.20	391,430,855.45
负债和净资产总计		377,656,836.78	391,911,124.18

注： 报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.5067 元，基金份额总额 250,211,253.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-40,399,955.00	35,603,504.91
1. 利息收入		396,877.87	74,304.18
其中：存款利息收入	6.4.7.13	60,202.81	36,904.08
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		336,675.06	37,400.10
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,932,976.95	27,479,856.88
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-6,258,822.29	23,502,083.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-1,678,858.66	1,497,980.58
股利收益	6.4.7.19	4,004,704.00	2,479,792.47
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的		-	-

收益			
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 20	-37, 159, 884. 84	7, 867, 316. 82
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. 21	296, 028. 92	182, 027. 03
减：二、营业总支出		520, 771. 97	795, 505. 57
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	274, 142. 22	211, 643. 68
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	91, 380. 72	70, 547. 92
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-	-
4. 投资顾问费	6. 4. 10. 2. 1. 1	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		597. 33	6, 822. 31
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	154, 651. 70	506, 491. 66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-40, 920, 726. 97	34, 807, 999. 34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-40, 920, 726. 97	34, 807, 999. 34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-40, 920, 726. 97	34, 807, 999. 34

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	232, 211, 253. 00	-	159, 219, 602. 45	391, 430, 855. 45
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错	-	-	-	-

更正				
其他	-	-	-	-
二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	232,211,253.00	-	159,219,602.45	391,430,855.45
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“-” 号填列)	18,000,000.00	-	-32,429,378.25	-14,429,378.25
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	-40,920,726.97	-40,920,726.97
(二)、 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)	18,000,000.00	-	8,491,348.72	26,491,348.72
其中:1. 基 金 申 购 款	48,000,000.00	-	22,890,874.38	70,890,874.38
2 .基 金 赎 回 款	-30,000,000.00	-	-14,399,525.66	-44,399,525.66
(三)、 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)	-	-	-	-

(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	250,211,253.00	-	126,790,224.20	377,001,477.20
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	188,211,253.00	-	65,349,824.16	253,561,077.16
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	188,211,253.00	-	65,349,824.16	253,561,077.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	32,000,000.00	-	47,391,945.41	79,391,945.41
(一)、综合收益总额	-	-	34,807,999.34	34,807,999.34
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以	32,000,000.00	-	12,583,946.07	44,583,946.07

“-”号填列)				
其中:1.基金申购款	82,000,000.00	-	32,771,618.72	114,771,618.72
2.基金赎回款	-50,000,000.00	-	-20,187,672.65	-70,187,672.65
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	220,211,253.00	-	112,741,769.57	332,953,022.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

邢彪

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]第 1504 号《关于准予鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资

基金法》和《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 490,173,730.00 元(含募集股票市值)，经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0669 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 11 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 490,211,253.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 37,523.00 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2020]99 号文审核同意，本基金 490,211,253.00 份基金份额于 2020 年 2 月 20 日在深交所挂牌交易。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 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 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 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

除 6.4.5.1 会计政策变更的说明所声明的变更外，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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《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》及《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”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

新金融工具准则改变了金融工具的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融工具的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、交易性金融资产-债券投资、交易性金融资产-资产支持证券投资、债权投资和卖出回购金融资产款等项目中，不单独列示应收利息或应付利息项目。

信用减值损失项目反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在利息收入项目中。其他项目的利息收入从利息收入项目调整至投资收益项目列示。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具，其投资收益包含期间交易费用的抵减。

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初

留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、其它资产、应付交易费用和其他负债，对其账面价值的影响金额分别为 880.67 元、2,983.61 元、35.60 元、-16,390.74 元、12,490.86 元、-200,060.61 元和 200,060.61 元。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	10,108,933.33
等于：本金	10,108,083.81
加：应计利息	849.52
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
合计	10,108,933.33

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		373,654,691.17	-	356,256,154.95	-17,398,536.22
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		373,654,691.17	-	356,256,154.95	-17,398,536.22

注：股票投资的公允价值和股票投资的公允价值变动均含可退替代款估值增值。

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

单位：人民币

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	12,334,000.00	-	-	
其中：股指期货投资	12,334,000.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	12,334,000.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2209	IC2209	10.00	12,728,000.00	394,000.00
合计				394,000.00
减：可抵销期货暂收款				394,000.00
净额				0.00

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应收利息	—
其他应收款	9,518.14
待摊费用	—
合计	9,518.14

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	131,719.45
其中：交易所市场	131,719.45
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	35,000.00
应退替代款	318,039.86
可退替代款	13,489.00
合计	582,550.87

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	232,211,253.00	232,211,253.00
本期申购	48,000,000.00	48,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-30,000,000.00	-30,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算调整	—	—
本期申购	—	—
本期赎回（以“-”号填列）	—	—
本期末	250,211,253.00	250,211,253.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

本期期初	137,431,525.33	21,788,077.12	159,219,602.45
本期利润	-3,761,457.27	-37,159,269.70	-40,920,726.97
本期基金份额交易产生的变动数	10,797,274.73	-2,305,926.01	8,491,348.72
其中：基金申购款	28,505,012.96	-5,614,138.58	22,890,874.38
基金赎回款	-17,707,738.23	3,308,212.57	-14,399,525.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	144,467,342.79	-17,677,118.59	126,790,224.20

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	16,592.05
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	43,110.26
其他	500.50
合计	60,202.81

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

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,986,971.02
股票投资收益——赎回差价收入	-2,271,851.27
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	-6,258,822.29

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	91,891,791.99
减：卖出股票成本总额	95,576,242.93
减：交易费用	302,520.08
买卖股票差价收入	-3,986,971.02

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	44,399,525.66
减：现金支付赎回款总额	23,408,533.66
减：赎回股票成本总额	23,262,843.27
减：交易费用	-
赎回差价收入	-2,271,851.27

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-1,678,858.66

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,004,704.00
其中：证券出借权益补偿收入	409,656.35
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,004,704.00

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-37,383,011.05
股票投资	-37,383,011.05
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	218,000.00
权证投资	-
期货投资	218,000.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动	-5,126.21

产生的预估增值税	
合计	-37,159,884.84

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	296,028.92
合计	296,028.92

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	339.00
指数使用费	70,000.00
存托服务费	10.14
合计	154,651.70

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	8,309,619.05	4.26	72,523,390.88	31.77

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	7,637.07	4.28	5,921.69	4.50
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	66,090.73	31.81	50,714.66	37.53

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。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	274,142.22	211,643.68
其中：支付销售机构的客户维护费	589.77	521.19

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.15%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	91,380.72	70,547.92

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 0.05%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×0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国信证券	6,841,161.00	4,550.49	638,040.00	65.11
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国信证券	-	-	-	-

注：（1）转融券金额为出借证券按照成交当日该证券收盘价计算的市值（展期转融券金额为按展期日该证券收盘价计算的市值）。

（2）转融券费用的计算公式为：每笔转融券费用=出借证券出借日或者展期日收盘价×该笔交易出借证券数量或者展期证券数量×该笔交易出借日或者展期日转融券费率×实际占用天数/360（计尾不计头）。

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

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天）	费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国信证券	202201110001983	掌趣科技	2022-1-11	20,460.00	4,400	14	0.032	25.46	-	-
国信证券	202201170000944	捷成股份	2022-1-17	25,230.00	3,000	14	0.032	47.10	-	-
国信证券	2022011900000794	万达信息	2022-1-19	88,288.00	6,200	14	0.032	149.11	-	-
国信证券	202201	长信科	2022-1	108,252.	9,300	14	0.032	182.82	-	-

	190000 0796	技	-19	00						
国信证券	202201 190000 0797	网宿科 技	2022-1 -19	40,768.0 0	5,600	14	0.032	68.85	-	
国信证券	202201 190000 0790	蓝色光 标	2022-1 -19	90,885.0 0	8,300	14	0.032	153.49	-	
国信证券	202201 210000 0883	红日药 业	2022-1 -21	20,670.0 0	3,000	14	0.032	31.23	-	
国信证券	202201 210000 0891	机器人	2022-1 -21	58,250.0 0	5,000	14	0.032	88.02	-	
国信证券	202202 070004 6819	红日药 业	2022-2 -7	18,540.0 0	3,000	14	0.032	23.07	-	
国信证券	202202 070004 6811	蓝色光 标	2022-2 -7	70,965.0 0	8,300	14	0.032	88.31	-	
国信证券	202202 070004 6813	长信科 技	2022-2 -7	91,977.0 0	9,300	14	0.032	114.46	-	
国信证券	202202 070004 6823	捷成股 份	2022-2 -7	18,600.0 0	3,000	14	0.032	23.15	-	
国信证券	202202 070004 6843	万达信 息	2022-2 -7	73,904.0 0	6,200	14	0.032	91.97	-	
国信证券	202202 210003 7841	蓝色光 标	2022-2 -21	67,811.0 0	8,300	14	0.032	84.39	-	
国信证券	202202 210003 7843	长信科 技	2022-2 -21	92,256.0 0	9,300	14	0.032	114.81	-	
国信证券	202202 210003 7839	红日药 业	2022-2 -21	18,840.0 0	3,000	14	0.032	23.45	-	
国信证券	202202 210004 7563	捷成股 份	2022-2 -21	19,830.0 0	3,000	14	0.032	24.68	-	
国信证券	202202 220000 0943	红日药 业	2022-2 -22	19,260.0 0	3,000	14	0.032	23.97	-	

国信证券	202202 220000 0945	网宿科技	2022-2 -22	21,840.0 0	3,000	14	0.032	27.18	-	
国信证券	202202 230000 0914	红日药业	2022-2 -23	20,250.0 0	3,000	14	0.032	25.20	-	
国信证券	202203 070004 2648	蓝色光标	2022-3 -7	42,728.0 0	5,600	14	0.032	53.17	-	
国信证券	202203 070003 5362	捷成股份	2022-3 -7	17,430.0 0	3,000	14	0.032	21.69	-	
国信证券	202203 070003 8082	红日药业	2022-3 -7	20,490.0 0	3,000	14	0.032	25.50	-	
国信证券	202203 070003 5356	长信科技	2022-3 -7	82,398.0 0	9,300	14	0.032	102.54	-	
国信证券	202203 080001 3666	红日药业	2022-3 -8	18,240.0 0	3,000	14	0.032	22.70	-	
国信证券	202203 080001 5974	网宿科技	2022-3 -8	18,750.0 0	3,000	14	0.032	23.33	-	
国信证券	202203 090001 8085	红日药业	2022-3 -9	17,610.0 0	3,000	14	0.032	21.91	-	
国信证券	202203 210002 8441	捷成股份	2022-3 -21	17,850.0 0	3,000	14	0.032	25.38	-	
国信证券	202203 210002 8437	红日药业	2022-3 -21	27,660.0 0	3,000	14	0.032	39.34	-	
国信证券	202203 210002 9413	蓝色光标	2022-3 -21	45,696.0 0	5,600	14	0.032	64.99	-	
国信证券	202203 220001 2707	红日药业	2022-3 -22	25,470.0 0	3,000	14	0.032	33.96	-	
国信证券	202203 230001 3735	红日药业	2022-3 -23	25,020.0 0	3,000	14	0.032	31.14	-	
国信证券	202203 230000	蓝色光标	2022-3 -23	40,900.0 0	5,000	14	0.032	50.90	-	

	1154									
国信证券	202204 060006 2419	蓝色光 标	2022-4 -6	44,050.0 0	5,000	14	0.032	54.82	-	
国信证券	202204 060006 2417	蓝色光 标	2022-4 -6	49,336.0 0	5,600	14	0.032	61.40	-	
国信证券	202204 060006 2411	红日药 业	2022-4 -6	24,990.0 0	3,000	14	0.032	31.10	-	
国信证券	202204 060006 2413	红日药 业	2022-4 -6	24,990.0 0	3,000	14	0.032	31.10	-	
国信证券	202204 060006 2415	红日药 业	2022-4 -6	24,990.0 0	3,000	14	0.032	31.10	-	
国信证券	202204 060005 1103	捷成股 份	2022-4 -6	18,750.0 0	3,000	14	0.032	23.33	-	
国信证券	202204 070000 0961	红日药 业	2022-4 -7	24,540.0 0	3,000	14	0.032	30.54	-	
国信证券	202204 200004 4824	红日药 业	2022-4 -20	18,660.0 0	3,000	14	0.032	24.88	-	
国信证券	202204 200004 4826	红日药 业	2022-4 -20	18,660.0 0	3,000	14	0.032	24.88	-	
国信证券	202204 200004 4828	红日药 业	2022-4 -20	18,660.0 0	3,000	14	0.032	24.88	-	
国信证券	202204 200004 4830	蓝色光 标	2022-4 -20	37,072.0 0	5,600	14	0.032	49.43	-	
国信证券	202204 200004 4832	蓝色光 标	2022-4 -20	33,100.0 0	5,000	14	0.032	44.13	-	
国信证券	202204 200004 4834	捷成股 份	2022-4 -20	14,940.0 0	3,000	14	0.032	19.92	-	
国信证券	202204 210001 3681	红日药 业	2022-4 -21	18,120.0 0	3,000	14	0.032	22.55	-	
国信证券	202204	蓝色光	2022-4	18,990.0	3,000	14	0.032	23.63	-	

	210000 1379	标	-21	0						
国信证券	202205 050007 2533	捷成股份	2022-5 -5	14,520.0 0	3,000	14	0.032	18.07	-	
国信证券	202205 050007 2525	蓝色光标	2022-5 -5	31,920.0 0	5,600	14	0.032	39.72	-	
国信证券	202205 050007 2527	蓝色光标	2022-5 -5	28,500.0 0	5,000	14	0.032	35.47	-	
国信证券	202205 050007 2529	蓝色光标	2022-5 -5	17,100.0 0	3,000	14	0.032	21.28	-	
国信证券	202205 050007 2517	红日药业	2022-5 -5	17,760.0 0	3,000	14	0.032	22.10	-	
国信证券	202205 050007 2519	红日药业	2022-5 -5	17,760.0 0	3,000	14	0.032	22.10	-	
国信证券	202205 050007 2521	红日药业	2022-5 -5	17,760.0 0	3,000	14	0.032	22.10	-	
国信证券	202205 050007 2523	红日药业	2022-5 -5	17,760.0 0	3,000	14	0.032	22.10	-	
国信证券	202205 190004 1423	红日药业	2022-5 -19	17,460.0 0	3,000	14	0.032	21.73	-	
国信证券	202205 190004 1425	红日药业	2022-5 -19	17,460.0 0	3,000	14	0.032	21.73	-	
国信证券	202205 190004 1427	红日药业	2022-5 -19	17,460.0 0	3,000	14	0.032	21.73	-	
国信证券	202205 190004 1429	红日药业	2022-5 -19	17,460.0 0	3,000	14	0.032	21.73	-	
国信证券	202205 190004 1431	蓝色光标	2022-5 -19	29,050.0 0	5,000	14	0.032	36.15	-	
国信证券	202205 190004 1433	蓝色光标	2022-5 -19	17,430.0 0	3,000	14	0.032	21.69	-	

国信证券	202205 190004 1445	蓝色光 标	2022-5 -19	32,536.0 0	5,600	14	0.032	40.49	-	
国信证券	202205 190004 1447	捷成股 份	2022-5 -19	14,700.0 0	3,000	14	0.032	18.29	-	
国信证券	202206 020001 3704	蓝色光 标	2022-6 -2	30,500.0 0	5,000	14	0.032	37.96	-	
国信证券	202206 020001 3706	蓝色光 标	2022-6 -2	34,160.0 0	5,600	14	0.032	42.51	-	
国信证券	202206 020001 3708	蓝色光 标	2022-6 -2	18,300.0 0	3,000	14	0.032	22.77	-	
国信证券	202206 020001 3696	红日药 业	2022-6 -2	16,260.0 0	3,000	14	0.032	20.23	-	
国信证券	202206 020001 3698	红日药 业	2022-6 -2	16,260.0 0	3,000	14	0.032	20.23	-	
国信证券	202206 020001 3700	红日药 业	2022-6 -2	16,260.0 0	3,000	14	0.032	20.23	-	
国信证券	202206 020001 3702	红日药 业	2022-6 -2	16,260.0 0	3,000	14	0.032	20.23	-	
国信证券	202206 070000 1336	红日药 业	2022-6 -7	29,800.0 0	5,000	14	0.032	37.08	-	
国信证券	202206 160001 5905	红日药 业	2022-6 -16	17,850.0 0	3,000	14	0.032	22.21	-	
国信证券	202206 160001 5907	红日药 业	2022-6 -16	17,850.0 0	3,000	14	0.032	22.21	-	
国信证券	202206 160001 5909	红日药 业	2022-6 -16	17,850.0 0	3,000	14	0.032	22.21	-	
国信证券	202206 160001 7959	红日药 业	2022-6 -16	17,850.0 0	3,000	14	0.032	22.21	-	
国信证券	202206 160001	蓝色光 标	2022-6 -16	34,550.0 0	5,000	14	0.032	43.00	-	

	7961									
国信证券	202206 160001 7963	蓝色光 标	2022-6 -16	38,696.0 0	5,600	14	0.032	48.16	-	
国信证券	202206 160001 7965	蓝色光 标	2022-6 -16	20,730.0 0	3,000	14	0.032	25.80	-	
国信证券	202206 210000 9414	红日药 业	2022-6 -21	34,250.0 0	5,000	14	0.032	42.62	38,500 .00	27.40
国信证券	202206 300002 1097	蓝色光 标	2022-6 -30	36,568.0 0	5,600	14	0.032	45.51	36,568 .00	-
国信证券	202206 300002 1093	红日药 业	2022-6 -30	23,100.0 0	3,000	14	0.032	28.75	23,100 .00	-
国信证券	202206 300002 1095	红日药 业	2022-6 -30	23,100.0 0	3,000	14	0.032	28.75	23,100 .00	-
国信证券	202206 300002 1099	蓝色光 标	2022-6 -30	19,590.0 0	3,000	14	0.032	24.38	19,590 .00	-
国信证券	202206 300002 1091	红日药 业	2022-6 -30	23,100.0 0	3,000	14	0.032	28.75	23,100 .00	-

注：上年度可比期间无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。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
鹏 华 中 证 500ETF联接	58,114,837.00	23.23	51,373,737.00	22.12

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率

标准相一致。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	10,108,933.33	16,592.05	10,454,819.36	16,064.51

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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	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	1,898	89,832.34

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(2022 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	受限期	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
301110	青木股份	2022 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	63.10	39.85	183	11,547.30	7,292.55	-
301112	信邦	2022 年	6 个月	新股流	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-

	智能	6 月 20 日		通受限						
301116	益客食品	2022 年 1 月 10 日	6 个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301117	佳缘科技	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股流通受限	46.80	54.44	240	11,232.00	13,065.60	-
301120	新特电气	2022 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301125	腾亚精工	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301135	瑞德智能	2022 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301151	冠龙节能	2022 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	30.82	21.46	473	14,577.86	10,150.58	-
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通受限	33.68	43.98	343	11,552.24	15,085.14	-
301158	德石股份	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股流通受限	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301160	翔楼新材	2022 年 5 月 25 日	6 个月	新股流通受限	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-
301162	国能日新	2022 年 4 月 19 日	6 个月	新股流通受限	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301163	宏德股份	2022 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股未上市	3.82	3.82	34,729	132,664.78	132,664.78	-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	3.82	3.82	3,859	14,741.38	14,741.38	-
301187	欧圣电气	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	21.33	22.54	730	15,570.90	16,454.20	-

301200	大族数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月	新股流通受限	76.56	51.92	217	16,613.52	11,266.64	-
301206	三元生物	2022 年 1 月 26 日	6 个月	新股流通受限	109.30	45.69	270	19,674.00	12,336.30	三元生物于 2022 年 6 月 17 日实施权益分派方案, 每 10 股派人民币 10 元, 并转增 5 股。
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新股流通受限	56.88	56.42	230	13,082.40	12,976.60	-
301217	铜冠铜箔	2022 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	17.27	14.83	971	16,769.17	14,399.93	-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	173.98	87.82	122	11,830.64	10,714.04	腾远钴业于 2022 年 5 月 24 日实施权益分派方案, 每 10 股派人民币 39.9 元, 并转增 8 股。
301220	亚香股份	2022 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301222	浙江恒威	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新股流通受限	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301228	实朴检测	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	1 个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-

301238	瑞泰新材	2022 年 6 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.18	32.07	996	19,103.28	31,941.72	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	1 个月内 (含)	新股未上市	33.65	33.65	3,663	123,259.95	123,259.95	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股流通受限	33.65	33.65	408	13,729.20	13,729.20	-
301259	艾布鲁	2022 年 4 月 18 日	6 个月	新股流通受限	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301266	宇邦新材	2022 年 5 月 30 日	6 个月	新股流通受限	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	28.50	34.87	472	13,452.00	16,458.64	-
301286	侨源股份	2022 年 6 月 6 日	6 个月	新股流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301288	清研环境	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301298	东利机械	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301302	华如科技	2022 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	52.03	56.42	302	15,713.06	17,038.84	-
688102	斯瑞新材	2022 年 3 月 9 日	6 个月	新股流通受限	10.48	12.23	6,030	63,194.40	73,746.90	-
688237	超卓航科	2022 年 6 月 24 日	1 个月内 (含)	新股未上市	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688267	中触媒	2022 年 2 月 9 日	6 个月	新股流通受限	41.90	31.90	1,643	68,841.70	52,411.70	-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	1 个月内 (含)	新股未上市	21.93	21.93	5,967	130,856.31	130,856.31	-

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
002670	国盛金控	2022 年 6 月 1 日	重大事项	9.60	2022 年 07 月 14 日	9.99	68,300	675,302.33	655,680.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值 单价	数量(单位: 股)	期末估值 总额
1	000009	中国宝安	2022 年 7 月 14 日	13.49	25,000	337,250.00
2	000012	南玻 A	2022 年 7 月 4 日	7.42	17,000	126,140.00
3	000027	深圳能源	2022 年 7 月 4 日	6.41	13,000	83,330.00
4	000031	大悦城	2022 年 7 月 11 日	4.00	12,000	48,000.00
5	000039	中集集团	2022 年 7 月 7 日	13.85	10,000	138,500.00
6	000089	深圳机场	2022 年 7 月 14 日	7.72	10,000	77,200.00
7	000158	常山北明	2022 年 7 月 4 日	6.00	10,000	60,000.00
8	000401	冀东水泥	2022 年 7 月 4 日	10.52	10,000	105,200.00
9	000402	金融街	2022 年 7 月 14 日	5.95	12,000	71,400.00
10	000415	渤海租赁	2022 年 7 月 5 日	2.17	32,000	69,440.00
11	000519	中兵红箭	2022 年 7 月 4 日	29.15	10,000	291,500.00
12	000528	柳工	2022 年 7 月 5 日	6.51	12,000	78,120.00
13	000540	中天金融	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 8 日	1.93	43,000	82,990.00
14	000547	航天发展	2022 年 7 月 14 日	11.94	13,000	155,220.00
15	000559	万向钱潮	2022 年 7 月 4 日	5.94	16,500	98,010.00
16	000563	陕国投 A	2022 年 7 月 5 日	3.12	25,000	78,000.00
17	000598	兴蓉环境	2022 年 7 月 4 日	5.11	22,000	112,420.00
18	000623	吉林敖东	2022 年 7 月 13 日	14.76	11,000	162,360.00
19	000629	攀钢钒钛	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 5 日	3.80	50,000	190,000.00
20	000630	铜陵有色	2022 年 7 月 4 日	3.26	82,000	267,320.00
21	000636	风华高科	2022 年 7 月 5 日	18.79	10,000	187,900.00
22	000656	金科股	2022 年 7 月 4 日-2022 年	2.86	35,600	101,816.00

		份	7 月 7 日			0
23	000671	阳光城	2022 年 7 月 7 日-2022 年 7 月 7 日	2.19	22,000	48,180.00
24	000685	中山公用	2022 年 7 月 4 日	7.68	10,000	76,800.00
25	000690	宝新能源	2022 年 7 月 5 日	4.38	28,000	122,640.00
26	000717	韶钢松山	2022 年 7 月 7 日	3.50	10,000	35,000.00
27	000718	苏宁环球	2022 年 7 月 14 日	3.68	15,000	55,200.00
28	000807	云铝股份	2022 年 7 月 7 日	9.88	14,000	138,320.00
29	000830	鲁西化工	2022 年 7 月 13 日	17.29	10,000	172,900.00
30	000878	云南铜业	2022 年 7 月 4 日	11.39	12,000	136,680.00
31	000883	湖北能源	2022 年 7 月 14 日	5.11	21,000	107,310.00
32	000887	中鼎股份	2022 年 7 月 4 日	18.24	10,000	182,400.00
33	000930	中粮科技	2022 年 7 月 8 日	9.04	14,000	126,560.00
34	000937	冀中能源	2022 年 7 月 5 日	7.46	13,000	96,980.00
35	000959	首钢股份	2022 年 7 月 14 日	4.76	10,000	47,600.00
36	000960	锡业股份	2022 年 7 月 11 日	16.77	10,000	167,700.00
37	000961	中南建设	2022 年 7 月 4 日	3.05	13,000	39,650.00
38	000967	盈峰环境	2022 年 7 月 7 日	5.06	10,000	50,600.00
39	000970	中科三环	2022 年 7 月 12 日	18.78	10,000	187,800.00
40	000975	银泰黄金	2022 年 7 月 14 日	9.74	17,000	165,580.00
41	000983	山西焦煤	2022 年 7 月 14 日	13.39	21,000	281,190.00
42	000987	越秀金控	2022 年 7 月 4 日	7.03	17,550	123,376.50
43	000988	华工科技	2022 年 7 月 14 日	23.17	10,000	231,700.00
44	000997	新大	2022 年 7 月 5 日	13.21	10,000	132,100.00

		陆				0
45	000998	隆平高科	2022 年 7 月 14 日	16.66	12,000	199,920.00
46	002002	鸿达兴业	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 7 日	3.71	25,000	92,750.00
47	002010	传化智联	2022 年 7 月 11 日	6.43	10,000	64,300.00
48	002030	达安基因	2022 年 7 月 6 日	17.19	12,000	206,280.00
49	002056	横店东磁	2022 年 7 月 14 日	26.62	8,000	212,960.00
50	002078	太阳纸业	2022 年 7 月 5 日-2022 年 7 月 14 日	12.31	20,000	246,200.00
51	002092	中泰化学	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	7.76	20,800	161,408.00
52	002124	天邦食品	2022 年 7 月 14 日	6.72	15,000	100,800.00
53	002127	南极电商	2022 年 7 月 14 日	5.34	20,000	106,800.00
54	002131	利欧股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 11 日	1.94	71,000	137,740.00
55	002152	广电运通	2022 年 7 月 4 日	9.27	16,000	148,320.00
56	002155	湖南黄金	2022 年 7 月 1 日	12.14	10,000	121,400.00
57	002174	游族网络	2022 年 7 月 5 日	9.77	9,100	88,907.00
58	002180	纳思达	2022 年 7 月 14 日	50.62	9,000	455,580.00
59	002183	怡亚通	2022 年 7 月 14 日	7.21	18,700	134,827.00
60	002191	劲嘉股份	2022 年 7 月 14 日	10.72	10,000	107,200.00
61	002195	二三四五	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 6 日	2.25	71,400	160,650.00
62	002203	海亮股份	2022 年 7 月 4 日	11.55	13,000	150,150.00
63	002221	东华能源	2022 年 7 月 4 日	9.31	14,000	130,340.00
64	002233	塔牌集团	2022 年 7 月 14 日	8.85	8,000	70,800.00
65	002244	滨江集团	2022 年 7 月 14 日	8.65	10,000	86,500.00
66	002249	大洋电	2022 年 7 月 7 日	6.14	10,000	61,400.00

		机				
67	002266	浙富控股	2022 年 7 月 5 日	4.79	27,000	129,330.00
68	002273	水晶光电	2022 年 7 月 13 日	12.11	13,000	157,430.00
69	002373	千方科技	2022 年 7 月 7 日	11.12	14,000	155,680.00
70	002384	东山精密	2022 年 7 月 5 日-2022 年 7 月 6 日	22.93	20,000	458,600.00
71	002385	大北农	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 11 日	7.81	35,000	273,350.00
72	002387	维信诺	2022 年 7 月 13 日	6.72	10,000	67,200.00
73	002390	信邦制药	2022 年 7 月 14 日	6.91	14,000	96,740.00
74	002408	齐翔腾达	2022 年 7 月 4 日	8.11	11,300	91,643.00
75	002416	爱施德	2022 年 7 月 6 日	9.30	9,200	85,560.00
76	002422	科伦药业	2022 年 7 月 6 日	18.70	10,000	187,000.00
77	002429	兆驰股份	2022 年 7 月 5 日-2022 年 7 月 14 日	3.84	21,000	80,640.00
78	002465	海格通信	2022 年 7 月 5 日	9.09	14,000	127,260.00
79	002497	雅化集团	2022 年 7 月 6 日	32.65	14,000	457,100.00
80	002500	山西证券	2022 年 7 月 14 日	5.74	22,000	126,280.00
81	002505	鹏都农牧	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	3.39	34,000	115,260.00
82	002506	协鑫集成	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 8 日	3.72	46,000	171,120.00
83	002563	森马服饰	2022 年 7 月 5 日	5.92	10,000	59,200.00
84	002624	完美世界	2022 年 7 月 13 日	14.37	13,000	186,810.00
85	002625	光启技术	2022 年 7 月 11 日	17.27	12,000	207,240.00
86	002670	国盛金控	2022 年 7 月 14 日	9.60	13,000	124,800.00
87	002739	万达电影	2022 年 7 月 4 日	13.65	13,000	177,450.00
88	002939	长城证券	2022 年 7 月 7 日	10.16	10,000	101,600.00
89	002958	青农商	2022 年 7 月 12 日	3.32	40,000	132,800.00

		行				0
90	300001	特锐德	2022 年 7 月 11 日	17.31	7,400	128,094.00
91	300017	网宿科技	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 14 日	5.36	25,700	137,752.00
92	300024	机器人	2022 年 7 月 14 日-2022 年 7 月 14 日	10.08	11,500	115,920.00
93	300026	红日药业	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	7.70	20,000	154,000.00
94	300058	蓝色光标	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 14 日	6.53	26,100	170,433.00
95	300070	碧水源	2022 年 7 月 14 日	5.21	22,000	114,620.00
96	300072	海新能科	2022 年 7 月 7 日-2022 年 7 月 14 日	5.06	18,000	91,080.00
97	300073	当升科技	2022 年 7 月 14 日	90.34	3,000	271,020.00
98	300088	长信科技	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 13 日	7.42	28,500	211,470.00
99	300115	长盈精密	2022 年 7 月 7 日-2022 年 7 月 8 日	10.31	10,400	107,224.00
100	300136	信维通信	2022 年 7 月 7 日-2022 年 7 月 14 日	16.85	10,500	176,925.00
101	300144	宋城演艺	2022 年 7 月 1 日	15.35	17,000	260,950.00
102	300146	汤臣倍健	2022 年 7 月 14 日	21.65	10,000	216,500.00
103	300166	东方国信	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 14 日	9.22	10,500	96,810.00
104	300168	万达信息	2022 年 7 月 4 日	9.44	15,000	141,600.00
105	300182	捷成股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 6 日	5.50	21,000	115,500.00
106	300212	易华录	2022 年 7 月 8 日	17.40	5,000	87,000.00
107	300244	迪安诊断	2022 年 7 月 4 日	31.10	5,000	155,500.00
108	300251	光线传媒	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 6 日	9.47	14,500	137,315.00
109	300257	开山股份	2022 年 7 月 4 日	14.96	3,000	44,880.00
110	300285	国瓷材料	2022 年 7 月 14 日	35.92	8,000	287,360.00
111	300308	中际旭创	2022 年 7 月 11 日	31.05	5,000	155,250.00

112	300357	我武生物	2022 年 7 月 6 日	52.03	3,500	182,105.00
113	300383	光环新网	2022 年 7 月 8 日-2022 年 7 月 14 日	10.42	11,300	117,746.00
114	300418	昆仑万维	2022 年 7 月 5 日	16.00	3,500	56,000.00
115	300463	迈克生物	2022 年 7 月 6 日	20.49	5,000	102,450.00
116	300482	万孚生物	2022 年 7 月 4 日	40.71	3,000	122,130.00
117	300618	寒锐钴业	2022 年 7 月 4 日	57.92	2,000	115,840.00
118	300677	英科医疗	2022 年 7 月 14 日	25.36	4,000	101,440.00
119	300869	康泰医学	2022 年 7 月 4 日	28.26	1,000	28,260.00
120	600006	东风汽车	2022 年 7 月 5 日	7.55	10,000	75,500.00
121	600008	首创环保	2022 年 7 月 5 日	2.90	54,900	159,210.00
122	600021	上海电力	2022 年 7 月 14 日	10.25	10,000	102,500.00
123	600026	中远海能	2022 年 7 月 8 日-2022 年 7 月 14 日	10.33	17,000	175,610.00
124	600037	歌华有线	2022 年 7 月 5 日	9.39	12,000	112,680.00
125	600039	四川路桥	2022 年 7 月 4 日	10.53	12,500	131,625.00
126	600060	海信视像	2022 年 7 月 14 日	12.50	8,000	100,000.00
127	600066	宇通客车	2022 年 7 月 14 日	8.65	16,000	138,400.00
128	600096	云天化	2022 年 7 月 13 日	31.48	15,000	472,200.00
129	600109	国金证券	2022 年 7 月 8 日	9.00	20,000	180,000.00
130	600120	浙江东方	2022 年 7 月 4 日	4.01	21,000	84,210.00
131	600126	杭钢股份	2022 年 7 月 14 日	5.12	14,000	71,680.00
132	600143	金发科技	2022 年 7 月 4 日	9.52	10,000	95,200.00
133	600153	建发股份	2022 年 7 月 11 日	13.07	15,000	196,050.00

134	600155	华创阳 安	2022 年 7 月 5 日	8.48	15,200	128,896.0 0
135	600157	永泰能 源	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 8 日	1.59	247,300	393,207.0 0
136	600160	巨化股 份	2022 年 7 月 14 日	13.15	14,000	184,100.0 0
137	600166	福田汽 车	2022 年 7 月 11 日	2.83	18,000	50,940.00
138	600167	联美控 股	2022 年 7 月 14 日	7.49	9,000	67,410.00
139	600170	上海建 工	2022 年 7 月 5 日	3.03	59,000	178,770.0 0
140	600177	雅戈尔	2022 年 7 月 11 日	6.63	28,000	185,640.0 0
141	600208	新湖中 宝	2022 年 7 月 4 日	2.76	53,600	147,936.0 0
142	600256	广汇能 源	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 13 日	10.54	36,300	382,602.0 0
143	600271	航天信 息	2022 年 7 月 14 日	10.94	10,000	109,400.0 0
144	600297	广汇汽 车	2022 年 7 月 7 日-2022 年 7 月 8 日	2.61	40,000	104,400.0 0
145	600307	酒钢宏 兴	2022 年 7 月 14 日	1.94	33,000	64,020.00
146	600325	华发股 份	2022 年 7 月 14 日	7.57	10,000	75,700.00
147	600339	中油工 程	2022 年 7 月 5 日	2.89	21,000	60,690.00
148	600348	华阳股 份	2022 年 7 月 14 日	15.46	13,000	200,980.0 0
149	600376	首开股 份	2022 年 7 月 7 日	4.91	10,000	49,100.00
150	600390	五矿资 本	2022 年 7 月 5 日-2022 年 7 月 7 日	4.89	29,000	141,810.0 0
151	600392	盛和资 源	2022 年 7 月 14 日	22.60	14,000	316,400.0 0
152	600398	海澜之 家	2022 年 7 月 4 日	4.75	17,000	80,750.00
153	600418	江淮汽 车	2022 年 7 月 4 日	17.16	18,000	308,880.0 0
154	600482	中国动 力	2022 年 7 月 14 日	15.71	11,000	172,810.0 0
155	600497	驰宏锌 锗	2022 年 7 月 14 日-2022 年 7 月 14 日	5.19	34,000	176,460.0 0

156	600499	科达制造	2022 年 7 月 14 日	20.64	13,000	268,320.00
157	600516	方大炭素	2022 年 7 月 5 日-2022 年 7 月 14 日	7.60	24,000	182,400.00
158	600517	国网英大	2022 年 7 月 5 日	5.19	18,000	93,420.00
159	600522	中天科技	2022 年 7 月 5 日-2022 年 7 月 5 日	23.10	34,500	796,950.00
160	600535	天士力	2022 年 7 月 13 日	10.51	10,000	105,100.00
161	600546	山煤国际	2022 年 7 月 14 日	19.46	10,000	194,600.00
162	600549	厦门钨业	2022 年 7 月 14 日	21.62	9,000	194,580.00
163	600580	卧龙电驱	2022 年 7 月 13 日	14.42	10,000	144,200.00
164	600582	天地科技	2022 年 7 月 13 日-2022 年 7 月 13 日	4.78	17,000	81,260.00
165	600637	东方明珠	2022 年 7 月 7 日	7.15	25,000	178,750.00
166	600642	申能股份	2022 年 7 月 7 日-2022 年 7 月 14 日	5.68	23,200	131,776.00
167	600667	太极实业	2022 年 7 月 5 日	7.38	16,000	118,080.00
168	600673	东阳光	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	8.99	16,000	143,840.00
169	600699	均胜电子	2022 年 7 月 14 日	15.71	10,000	157,100.00
170	600704	物产中大	2022 年 7 月 14 日	5.13	30,000	153,900.00
171	600705	中航产融	2022 年 7 月 14 日	3.46	57,000	197,220.00
172	600707	彩虹股份	2022 年 7 月 14 日	4.68	14,000	65,520.00
173	600717	天津港	2022 年 7 月 14 日	4.01	15,000	60,150.00
174	600728	佳都科技	2022 年 7 月 5 日	6.46	13,000	83,980.00
175	600737	中粮糖业	2022 年 7 月 4 日	7.52	14,600	109,792.00
176	600739	辽宁成大	2022 年 7 月 4 日	14.58	13,000	189,540.00
177	600755	厦门国贸	2022 年 7 月 4 日	7.50	19,000	142,500.00
178	600782	新钢股	2022 年 7 月 4 日	5.04	12,700	64,008.00

		份				
179	600811	东方集团	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 7 日	2.83	23,000	65,090.00
180	600820	隧道股份	2022 年 7 月 5 日	6.12	20,000	122,400.00
181	600823	世茂股份	2022 年 7 月 4 日	2.98	13,000	38,740.00
182	600827	百联股份	2022 年 7 月 5 日	13.21	10,000	132,100.00
183	600839	四川长虹	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 11 日	2.88	33,000	95,040.00
184	600863	内蒙华电	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	3.65	30,700	112,055.00
185	600871	石化油服	2022 年 7 月 7 日-2022 年 7 月 12 日	1.89	40,000	75,600.00
186	600875	东方电气	2022 年 7 月 6 日	16.45	10,000	164,500.00
187	600901	江苏租赁	2022 年 7 月 7 日	5.13	12,400	63,612.00
188	600928	西安银行	2022 年 7 月 14 日	3.67	13,000	47,710.00
189	600968	海油发展	2022 年 7 月 7 日	2.58	18,000	46,440.00
190	600970	中材国际	2022 年 7 月 11 日	9.69	10,000	96,900.00
191	600988	赤峰黄金	2022 年 7 月 14 日	15.95	13,800	220,110.00
192	601016	节能风电	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 4 日	4.80	26,000	124,800.00
193	601058	赛轮轮胎	2022 年 7 月 7 日	11.27	20,000	225,400.00
194	601106	中国一重	2022 年 7 月 5 日	3.07	26,000	79,820.00
195	601168	西部矿业	2022 年 7 月 4 日	11.83	16,500	195,195.00
196	601179	中国西电	2022 年 7 月 14 日	4.68	21,000	98,280.00
197	601198	东兴证券	2022 年 7 月 14 日	8.90	10,000	89,000.00
198	601228	广州港	2022 年 7 月 14 日	3.67	12,000	44,040.00
199	601333	广深铁路	2022 年 7 月 14 日	2.18	36,000	78,480.00
200	601598	中国外运	2022 年 7 月 4 日	3.88	17,000	65,960.00

201	601608	中信重工	2022 年 7 月 14 日	3.79	22,000	83,380.00
202	601611	中国核建	2022 年 7 月 14 日	8.39	8,000	67,120.00
203	601615	明阳智能	2022 年 7 月 1 日	33.80	20,000	676,000.00
204	601636	旗滨集团	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 4 日	12.75	20,100	256,275.00
205	601696	中银证券	2022 年 7 月 12 日	13.30	20,000	266,000.00
206	601699	潞安环能	2022 年 7 月 14 日	14.62	12,000	175,440.00
207	601717	郑煤机	2022 年 7 月 14 日	14.41	10,000	144,100.00
208	601718	际华集团	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 4 日	3.10	34,000	105,400.00
209	601866	中远海发	2022 年 7 月 4 日	3.00	42,000	126,000.00
210	601872	招商轮船	2022 年 7 月 14 日	5.76	34,000	195,840.00
211	601880	辽港股份	2022 年 7 月 7 日	1.70	55,000	93,500.00
212	601958	金钼股份	2022 年 7 月 13 日	8.84	10,000	88,400.00
213	601991	大唐发电	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 4 日	2.43	31,000	75,330.00
214	603077	和邦生物	2022 年 7 月 7 日-2022 年 7 月 14 日	4.26	65,000	276,900.00
215	603225	新凤鸣	2022 年 7 月 5 日	11.54	9,500	109,630.00
216	688002	睿创微纳	2022 年 7 月 6 日	39.72	3,000	119,160.00
217	688088	虹软科技	2022 年 7 月 11 日	31.59	2,000	63,180.00
218	688099	晶晨股份	2022 年 7 月 5 日	101.00	3,000	303,000.00
219	688180	君实生物-U	2022 年 7 月 11 日	75.34	3,500	263,690.00
220	688208	道通科技	2022 年 7 月 5 日	32.92	3,000	98,760.00
221	688289	圣湘生物	2022 年 7 月 6 日	29.61	1,000	29,610.00
222	688777	中控技术	2022 年 7 月 1 日	72.76	3,000	218,280.00

合计	-	-	-	-	4,199,850	32,515,900.50
----	---	---	---	---	-----------	---------------

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

本基金为指数型基金。本基金主要投资于标的指数成份股，备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股(包含中小板，创业板及其他经中国证监会核准的股票，存托凭证)，债券(含国债，地方政府债，金融债，企业债，公司债，央行票据，中期票据，短期融资券，超短期融资券，次级债，可转换债券，可交换债券等)，货币市场工具，同业存单，资产支持证券，股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可依据法律法规的规定，参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券；以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对于借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2021 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、组合在短期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 2022 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%。

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 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,108,933.33	-	-	-	10,108,933.33
结算备付金	9,170,759.81	-	-	-	9,170,759.81
存出保证金	1,817,411.24	-	-	-	1,817,411.24
交易性金融资产	-	-	-	356,256,154.95	356,256,154.95
应收股利	-	-	-	66,073.16	66,073.16
应收清算款	-	-	-	227,986.15	227,986.15
其他资产	-	-	-	9,518.14	9,518.14
资产总计	21,097,104.38	-	-	356,559,732.40	377,656,836.78
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	45,459.31	45,459.31
应付托管费	-	-	-	15,153.07	15,153.07
应付清算款	-	-	-	10,352.81	10,352.81
应交税费	-	-	-	1,843.52	1,843.52
其他负债	-	-	-	582,550.87	582,550.87
负债总计	-	-	-	655,359.58	655,359.58
利率敏感度缺口	21,097,104.38	-	-	355,904,372.82	377,001,477.20
上年度末 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	9,693,729.64	-	-	-	9,693,729.64
结算备付金	10,374,271.32	-	-	-	10,374,271.32
存出保证金	2,124,606.75	-	-	-	2,124,606.75
交易性金融资产	-	-	-	369,701,845.73	369,701,845.73
应收股利	-	-	-	280.00	280.00
其他资产	-	-	-	16,390.74	16,390.74
资产总计	22,192,607.71	-	-	369,718,516.47	391,911,124.18
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	50,651.98	50,651.98
应付托管费	-	-	-	16,883.98	16,883.98
应交税费	-	-	-	7,672.16	7,672.16
其他负债	-	-	-	405,060.61	405,060.61

负债总计	-	-	-	480,268.73	480,268.73
利率敏感度缺口	22,192,607.71	-	-	-369,238,247.74	391,430,855.45

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 2022 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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券，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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	356,256,154.95	94.50	369,701,845.73	94.45
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	356,256,154.95	94.50	369,701,845.73	94.45

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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	18,495,692.47	19,187,940.53
	业绩比较基准下降 5%	-18,495,692.47	-19,187,940.53

注：无。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	354,469,524.65
第二层次	1,255,678.71
第三层次	530,951.59
合计	356,256,154.95

6.4.14.2.2 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、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 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	356,256,154.95	94.33
	其中：股票	356,256,154.95	94.33
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	19,279,693.14	5.11
8	其他各项资产	2,120,988.69	0.56
9	合计	377,656,836.78	100.00

注：1. 上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2.1 的合计项不含可退替代款估值增值。

2. 报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：854,400.00 元，占净值比 0.23%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

3. 报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 32,515,900.50 元，占基金资产净值比为 8.62%。

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	3,252,890.40	0.86
B	采矿业	15,763,962.12	4.18
C	制造业	210,829,482.42	55.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,940,620.80	2.90
E	建筑业	4,584,667.00	1.22
F	批发和零售业	13,694,411.56	3.63
G	交通运输、仓储和邮政业	9,457,736.35	2.51
H	住宿和餐饮业	746,752.80	0.20
I	信息传输、软件和	26,310,395.19	6.98

	信息技术服务业		
J	金融业	31,455,706.88	8.34
K	房地产业	8,380,660.00	2.22
L	租赁和商务服务业	4,291,971.00	1.14
M	科学研究和技术服务业	4,418,459.00	1.17
N	水利、环境和公共设施管理业	2,578,627.40	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	830,370.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	4,743,526.00	1.26
S	综合	2,601,501.00	0.69
	合计	354,881,739.92	94.13

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	999,832.01	0.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,554.87	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,586.82	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	159,452.18	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	136,989.15	0.04
R	文化、体育和娱乐	-	-

	业		
S	综合	-	-
	合计	1,374,415.03	0.36

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	600522	中天科技	147,000	3,395,700.00	0.90
2	601615	明阳智能	90,500	3,058,900.00	0.81
3	600256	广汇能源	247,400	2,607,596.00	0.69
4	300769	德方纳米	5,700	2,329,476.00	0.62
5	600096	云天化	69,100	2,175,268.00	0.58
6	300012	华测检测	90,400	2,098,184.00	0.56
7	002497	雅化集团	62,000	2,024,300.00	0.54
8	002407	多氟多	41,200	2,015,092.00	0.53
9	002240	盛新锂能	32,500	1,961,700.00	0.52
10	300390	天华超净	22,100	1,931,540.00	0.51
11	002180	纳思达	38,100	1,928,622.00	0.51
12	600157	永泰能源	1,196,300	1,902,117.00	0.50
13	600885	宏发股份	44,820	1,875,717.00	0.50
14	000009	中国宝安	138,800	1,872,412.00	0.50
15	600141	兴发集团	41,900	1,843,181.00	0.49
16	300073	当升科技	19,000	1,716,460.00	0.46
17	600392	盛和资源	75,500	1,706,300.00	0.45
18	002384	东山精密	73,600	1,687,648.00	0.45
19	603613	国联股份	18,735	1,659,921.00	0.44
20	002756	永兴材料	10,900	1,659,089.00	0.44
21	600418	江淮汽车	94,000	1,613,040.00	0.43
22	300285	国瓷材料	43,200	1,551,744.00	0.41
23	600765	中航重机	47,500	1,528,550.00	0.41
24	600399	抚顺特钢	84,900	1,519,710.00	0.40
25	600233	圆通速递	74,000	1,508,860.00	0.40
26	601555	东吴证券	215,690	1,494,731.70	0.40
27	601058	赛轮轮胎	131,900	1,486,513.00	0.39
28	600487	亨通光电	101,800	1,480,172.00	0.39
29	600563	法拉电子	7,200	1,477,152.00	0.39
30	000983	山西焦煤	110,270	1,476,515.30	0.39
31	300037	新宙邦	27,960	1,469,577.60	0.39

32	600499	科达制造	71,102	1,467,545.28	0.39
33	600732	爱旭股份	43,800	1,446,276.00	0.38
34	603077	和邦生物	332,800	1,417,728.00	0.38
35	688180	君实生物-U	18,500	1,393,790.00	0.37
36	002385	大北农	178,300	1,392,523.00	0.37
37	603456	九洲药业	26,900	1,390,730.00	0.37
38	688122	西部超导	15,000	1,383,000.00	0.37
39	601108	财通证券	174,900	1,376,463.00	0.37
40	300363	博腾股份	17,600	1,372,624.00	0.36
41	002268	卫 士 通	31,800	1,364,538.00	0.36
42	688099	晶晨股份	13,300	1,343,300.00	0.36
43	600486	扬农化工	9,900	1,319,472.00	0.35
44	600298	安琪酵母	26,900	1,311,375.00	0.35
45	603345	安井食品	7,800	1,309,386.00	0.35
46	000519	中兵红箭	44,900	1,308,835.00	0.35
47	300144	宋城演艺	84,400	1,295,540.00	0.34
48	000630	铜陵有色	396,700	1,293,242.00	0.34
49	600862	中航高科	44,930	1,262,533.00	0.33
50	000988	华工科技	54,000	1,251,180.00	0.33
51	002353	杰瑞股份	30,900	1,245,270.00	0.33
52	603605	珀莱雅	7,500	1,238,850.00	0.33
53	000783	长江证券	208,400	1,235,812.00	0.33
54	601077	渝农商行	333,300	1,233,210.00	0.33
55	601168	西部矿业	102,600	1,213,758.00	0.32
56	002625	光启技术	69,500	1,200,265.00	0.32
57	601696	中银证券	89,700	1,193,010.00	0.32
58	601162	天风证券	373,300	1,187,094.00	0.31
59	300146	汤臣倍健	54,800	1,186,420.00	0.31
60	300724	捷佳伟创	13,100	1,170,485.00	0.31
61	002028	思源电气	32,800	1,169,648.00	0.31
62	688777	中控技术	16,000	1,164,160.00	0.31
63	002056	横店东磁	43,700	1,163,294.00	0.31
64	002797	第一创业	181,000	1,160,210.00	0.31
65	002507	涪陵榨菜	33,400	1,152,968.00	0.31
66	603517	绝味食品	19,800	1,144,836.00	0.30
67	600988	赤峰黄金	71,600	1,142,020.00	0.30
68	000932	华菱钢铁	223,100	1,135,579.00	0.30
69	002185	华天科技	120,700	1,132,166.00	0.30
70	603589	口子窖	19,300	1,131,173.00	0.30
71	601128	常熟银行	147,600	1,127,664.00	0.30
72	601636	旗滨集团	86,800	1,106,700.00	0.29
73	603026	石大胜华	7,600	1,104,660.00	0.29

74	600521	华海药业	48,300	1,096,410.00	0.29
75	002603	以岭药业	44,900	1,091,070.00	0.29
76	600039	四川路桥	103,400	1,088,802.00	0.29
77	002326	永太科技	33,000	1,086,690.00	0.29
78	600109	国金证券	120,300	1,082,700.00	0.29
79	601607	上海医药	59,700	1,079,376.00	0.29
80	000830	鲁西化工	62,000	1,071,980.00	0.28
81	002078	太阳纸业	86,800	1,068,508.00	0.28
82	605117	德业股份	3,800	1,063,582.00	0.28
83	002624	完美世界	73,100	1,050,447.00	0.28
84	600153	建发股份	80,100	1,046,907.00	0.28
85	600546	山煤国际	53,400	1,039,164.00	0.28
86	603939	益丰药房	19,300	1,019,619.00	0.27
87	688390	固德威	3,220	1,007,892.20	0.27
88	601872	招商轮船	174,500	1,005,120.00	0.27
89	002422	科伦药业	53,700	1,004,190.00	0.27
90	600348	华阳股份	64,700	1,000,262.00	0.27
91	600705	中航产融	288,100	996,826.00	0.26
92	600497	驰宏锌锗	191,900	995,961.00	0.26
93	000738	航发控制	35,400	994,740.00	0.26
94	603267	鸿远电子	7,400	994,042.00	0.26
95	601990	南京证券	119,000	992,460.00	0.26
96	600177	雅戈尔	149,500	991,185.00	0.26
97	600549	厦门钨业	45,800	990,196.00	0.26
98	000831	五矿稀土	31,600	987,500.00	0.26
99	600875	东方电气	59,800	983,710.00	0.26
100	000970	中科三环	52,375	983,602.50	0.26
101	300699	光威复材	16,700	983,129.00	0.26
102	300088	长信科技	132,100	980,182.00	0.26
103	603127	昭衍新药	8,600	978,680.00	0.26
104	600160	巨化股份	72,600	954,690.00	0.25
105	000999	华润三九	21,200	954,000.00	0.25
106	300676	华大基因	13,300	953,610.00	0.25
107	600859	王府井	36,600	950,868.00	0.25
108	002138	顺络电子	34,700	945,575.00	0.25
109	000998	隆平高科	56,700	944,622.00	0.25
110	002673	西部证券	144,400	944,376.00	0.25
111	002572	索菲亚	34,300	943,250.00	0.25
112	601699	潞安环能	64,400	941,528.00	0.25
113	600516	方大炭素	122,900	934,040.00	0.25
114	002557	洽洽食品	16,400	933,652.00	0.25
115	603444	吉比特	2,400	931,200.00	0.25

116	600143	金发科技	97,000	923,440.00	0.24
117	000807	云铝股份	93,300	921,804.00	0.24
118	002508	老板电器	25,500	918,765.00	0.24
119	000039	中集集团	66,100	915,485.00	0.24
120	601997	贵阳银行	157,500	915,075.00	0.24
121	600482	中国动力	58,100	912,751.00	0.24
122	002030	达安基因	52,896	909,282.24	0.24
123	002273	水晶光电	74,900	907,039.00	0.24
124	000960	锡业股份	53,900	903,903.00	0.24
125	002465	海格通信	99,200	901,728.00	0.24
126	000629	攀钢钒钛	231,600	880,080.00	0.23
127	300357	我武生物	16,900	879,307.00	0.23
128	300136	信维通信	52,100	877,885.00	0.23
129	000728	国元证券	140,900	876,398.00	0.23
130	300058	蓝色光标	134,100	875,673.00	0.23
131	000975	银泰黄金	89,660	873,288.40	0.23
132	600170	上海建工	287,600	871,428.00	0.23
133	600536	中国软件	21,280	863,755.20	0.23
134	600704	物产中大	167,800	860,814.00	0.23
135	002092	中泰化学	110,900	860,584.00	0.23
136	601577	长沙银行	108,200	858,026.00	0.23
137	002409	雅克科技	15,400	854,854.00	0.23
138	689009	九号公司-WD	19,200	854,400.00	0.23
139	600079	人福医药	52,800	844,800.00	0.22
140	603198	迎驾贡酒	12,900	840,306.00	0.22
141	002294	信立泰	29,900	840,190.00	0.22
142	600739	辽宁成大	57,600	839,808.00	0.22
143	300244	迪安诊断	26,700	830,370.00	0.22
144	002223	鱼跃医疗	32,300	828,818.00	0.22
145	300474	景嘉微	12,100	827,519.00	0.22
146	300418	昆仑万维	51,500	824,000.00	0.22
147	000547	航天发展	69,000	823,860.00	0.22
148	600415	小商品城	147,800	823,246.00	0.22
149	002372	伟星新材	34,200	822,168.00	0.22
150	002506	协鑫集成	220,500	820,260.00	0.22
151	002739	万达电影	60,000	819,000.00	0.22
152	000636	风华高科	43,500	817,365.00	0.22
153	300558	贝达药业	13,400	814,720.00	0.22
154	300253	卫宁健康	92,400	811,272.00	0.22
155	600699	均胜电子	51,500	809,065.00	0.21
156	600372	中航电子	41,500	804,685.00	0.21
157	300308	中际旭创	25,800	801,090.00	0.21

158	300296	利亚德	109,500	799,350.00	0.21
159	600637	东方明珠	110,300	788,645.00	0.21
160	002683	广东宏大	28,200	784,806.00	0.21
161	600867	通化东宝	75,700	782,738.00	0.21
162	600315	上海家化	18,200	778,050.00	0.21
163	601016	节能风电	162,000	777,600.00	0.21
164	600985	淮北矿业	53,400	777,504.00	0.21
165	600236	桂冠电力	127,200	774,648.00	0.21
166	601198	东兴证券	87,000	774,300.00	0.21
167	000887	中鼎股份	42,400	773,376.00	0.21
168	600026	中远海能	74,800	772,684.00	0.20
169	002156	通富微电	50,100	771,540.00	0.20
170	002299	圣农发展	40,200	771,036.00	0.20
171	600171	上海贝岭	30,600	765,918.00	0.20
172	002065	东华软件	120,800	763,456.00	0.20
173	300832	新产业	16,900	762,359.00	0.20
174	600380	健康元	61,700	761,995.00	0.20
175	600879	航天电子	117,100	759,979.00	0.20
176	600642	申能股份	132,200	750,896.00	0.20
177	300026	红日药业	97,000	746,900.00	0.20
178	600258	首旅酒店	30,111	746,752.80	0.20
179	000750	国海证券	205,200	744,876.00	0.20
180	002936	郑州银行	276,861	744,756.09	0.20
181	002408	齐翔腾达	91,800	744,498.00	0.20
182	000623	吉林敖东	50,100	739,476.00	0.20
183	688185	康希诺	3,700	736,596.00	0.20
184	002203	海亮股份	63,500	733,425.00	0.19
185	000729	燕京啤酒	75,900	733,194.00	0.19
186	000400	许继电气	38,000	729,600.00	0.19
187	600673	东阳光	81,100	729,089.00	0.19
188	000878	云南铜业	64,000	728,960.00	0.19
189	000513	丽珠集团	20,100	727,821.00	0.19
190	600820	隧道股份	118,400	724,608.00	0.19
191	600038	中直股份	15,900	718,680.00	0.19
192	600529	山东药玻	25,600	715,520.00	0.19
193	601717	郑煤机	49,600	714,736.00	0.19
194	600801	华新水泥	36,600	714,066.00	0.19
195	600580	卧龙电驱	49,500	713,790.00	0.19
196	002439	启明星辰	35,700	711,501.00	0.19
197	600369	西南证券	178,800	709,836.00	0.19
198	300017	网宿科技	131,700	705,912.00	0.19
199	002183	怡亚通	97,900	705,859.00	0.19

200	002131	利欧股份	363,700	705,578.00	0.19
201	300383	光环新网	67,700	705,434.00	0.19
202	603568	伟明环保	21,020	701,437.40	0.19
203	600166	福田汽车	247,800	701,274.00	0.19
204	600316	洪都航空	23,100	698,544.00	0.19
205	600848	上海临港	51,500	698,340.00	0.19
206	002444	巨星科技	36,945	696,043.80	0.18
207	002958	青农商行	209,400	695,208.00	0.18
208	002195	二三四五	308,200	693,450.00	0.18
209	688256	寒武纪-U	10,700	692,290.00	0.18
210	600909	华安证券	151,640	689,962.00	0.18
211	600027	华电国际	175,500	689,715.00	0.18
212	600325	华发股份	91,100	689,627.00	0.18
213	601005	重庆钢铁	361,000	689,510.00	0.18
214	600008	首创环保	237,100	687,590.00	0.18
215	300001	特锐德	39,200	678,552.00	0.18
216	300024	机器人	66,700	672,336.00	0.18
217	300618	寒锐钴业	11,600	671,872.00	0.18
218	000825	太钢不锈	122,700	668,715.00	0.18
219	002500	山西证券	115,920	665,380.80	0.18
220	002926	华西证券	84,800	664,832.00	0.18
221	688521	芯原股份-U	13,400	661,960.00	0.18
222	002373	千方科技	59,500	661,640.00	0.18
223	603218	日月股份	26,000	660,400.00	0.18
224	002430	杭氧股份	21,100	659,586.00	0.17
225	000050	深天马 A	66,100	659,017.00	0.17
226	000027	深圳能源	102,380	656,255.80	0.17
227	002670	国盛金控	68,300	655,680.00	0.17
228	600271	航天信息	59,800	654,212.00	0.17
229	000739	普洛药业	31,600	652,224.00	0.17
230	002250	联化科技	39,800	651,526.00	0.17
231	002212	天融信	63,800	647,570.00	0.17
232	600863	内蒙华电	175,600	640,940.00	0.17
233	601866	中远海发	213,400	640,200.00	0.17
234	600208	新潮中宝	231,500	638,940.00	0.17
235	600118	中国卫星	31,800	638,544.00	0.17
236	603233	大参林	20,360	637,268.00	0.17
237	688009	中国通号	139,200	630,576.00	0.17
238	300677	英科医疗	24,800	628,928.00	0.17
239	000060	中金岭南	140,800	627,968.00	0.17
240	002985	北摩高科	10,682	625,751.56	0.17
241	002249	大洋电机	101,900	625,666.00	0.17

242	300009	安科生物	61,692	623,706.12	0.17
243	601992	金隅集团	224,400	621,588.00	0.16
244	000778	新兴铸管	128,800	620,816.00	0.16
245	002152	广电运通	66,800	619,236.00	0.16
246	600066	宇通客车	71,500	618,475.00	0.16
247	603156	养元饮品	27,200	617,984.00	0.16
248	603658	安图生物	12,600	616,014.00	0.16
249	300182	捷成股份	110,900	609,950.00	0.16
250	300070	碧水源	117,000	609,570.00	0.16
251	300168	万达信息	63,900	603,216.00	0.16
252	603858	步长制药	30,600	603,126.00	0.16
253	002966	苏州银行	98,680	601,948.00	0.16
254	000401	冀东水泥	57,200	601,744.00	0.16
255	600998	九州通	50,400	600,264.00	0.16
256	300251	光线传媒	63,200	598,504.00	0.16
257	600056	中国医药	40,300	597,246.00	0.16
258	002191	劲嘉股份	55,400	593,888.00	0.16
259	002128	电投能源	41,400	592,848.00	0.16
260	600390	五矿资本	121,100	592,179.00	0.16
261	600970	中材国际	61,000	591,090.00	0.16
262	002831	裕同科技	20,000	591,000.00	0.16
263	000021	深科技	50,400	586,656.00	0.16
264	000997	新大陆	44,400	586,524.00	0.16
265	600667	太极实业	79,300	585,234.00	0.16
266	300482	万孚生物	14,300	582,153.00	0.15
267	002505	鹏都农牧	171,600	581,724.00	0.15
268	002244	滨江集团	66,900	578,685.00	0.15
269	002221	东华能源	62,100	578,151.00	0.15
270	600528	中铁工业	71,700	577,185.00	0.15
271	600021	上海电力	56,300	577,075.00	0.15
272	000656	金科股份	201,200	575,432.00	0.15
273	600062	华润双鹤	22,400	574,784.00	0.15
274	688002	睿创微纳	14,427	573,040.44	0.15
275	600839	四川长虹	198,800	572,544.00	0.15
276	603885	吉祥航空	31,700	570,283.00	0.15
277	600297	广汇汽车	218,300	569,763.00	0.15
278	600827	百联股份	43,100	569,351.00	0.15
279	000987	越秀金控	80,975	569,254.25	0.15
280	002396	星网锐捷	25,100	568,264.00	0.15
281	600598	北大荒	38,300	565,308.00	0.15
282	002127	南极电商	105,700	564,438.00	0.15
283	603707	健友股份	19,990	563,718.00	0.15

284	002019	亿帆医药	39,900	557,802.00	0.15
285	600155	华创阳安	65,601	556,296.48	0.15
286	600201	生物股份	60,638	555,444.08	0.15
287	600498	烽火通信	38,300	554,584.00	0.15
288	688188	柏楚电子	2,520	554,500.80	0.15
289	002266	浙富控股	115,600	553,724.00	0.15
290	002155	湖南黄金	45,253	549,371.42	0.15
291	000012	南玻A	73,900	548,338.00	0.15
292	600259	广晟有色	10,800	547,020.00	0.15
293	600409	三友化工	66,600	545,454.00	0.14
294	000930	中粮科技	60,200	544,208.00	0.14
295	000883	湖北能源	106,100	542,171.00	0.14
296	600511	国药股份	20,200	540,956.00	0.14
297	600718	东软集团	46,800	538,668.00	0.14
298	002153	石基信息	33,840	537,040.80	0.14
299	600755	厦门国贸	71,100	533,250.00	0.14
300	002124	天邦食品	79,120	531,686.40	0.14
301	002511	中顺洁柔	42,300	529,596.00	0.14
302	000686	东北证券	75,600	528,444.00	0.14
303	600060	海信视像	42,200	527,500.00	0.14
304	600959	江苏有线	161,600	526,816.00	0.14
305	603712	七一二	16,609	523,183.50	0.14
306	600282	南钢股份	165,800	522,270.00	0.14
307	000581	威孚高科	27,000	519,750.00	0.14
308	600895	张江高科	41,700	519,165.00	0.14
309	600782	新钢股份	102,900	518,616.00	0.14
310	601880	辽港股份	304,100	516,970.00	0.14
311	000709	河钢股份	228,700	516,862.00	0.14
312	601179	中国西电	110,400	516,672.00	0.14
313	600566	济川药业	19,000	516,040.00	0.14
314	000690	宝新能源	117,100	512,898.00	0.14
315	600022	山东钢铁	294,700	512,778.00	0.14
316	600064	南京高科	46,500	511,500.00	0.14
317	002939	长城证券	50,100	509,016.00	0.14
318	600535	天士力	48,400	508,684.00	0.13
319	300376	易事特	62,300	505,876.00	0.13
320	002701	奥瑞金	97,000	504,400.00	0.13
321	601778	晶科科技	93,400	504,360.00	0.13
322	002002	鸿达兴业	134,500	498,995.00	0.13
323	300630	普利制药	14,101	495,650.15	0.13
324	600216	浙江医药	36,300	495,495.00	0.13
325	600500	中化国际	74,400	494,760.00	0.13

326	600808	马钢股份	130,100	493,079.00	0.13
327	000598	兴蓉环境	96,400	492,604.00	0.13
328	600037	歌华有线	52,400	492,036.00	0.13
329	002468	申通快递	41,163	490,662.96	0.13
330	002532	天山铝业	75,100	490,403.00	0.13
331	600663	陆家嘴	47,300	490,028.00	0.13
332	600728	佳都科技	75,700	489,022.00	0.13
333	600567	山鹰国际	174,000	481,980.00	0.13
334	688208	道通科技	14,600	480,632.00	0.13
335	002595	豪迈科技	21,500	480,310.00	0.13
336	600517	国网英大	92,300	479,037.00	0.13
337	002004	华邦健康	85,300	475,974.00	0.13
338	603225	新凤鸣	41,200	475,448.00	0.13
339	603866	桃李面包	28,720	475,316.00	0.13
340	601456	国联证券	38,600	473,622.00	0.13
341	300463	迈克生物	23,000	471,270.00	0.13
342	000785	居然之家	105,400	469,030.00	0.12
343	600597	光明乳业	37,100	468,573.00	0.12
344	688289	圣湘生物	15,808	468,074.88	0.12
345	002745	木林森	47,900	467,983.00	0.12
346	002429	兆驰股份	121,800	467,712.00	0.12
347	300115	长盈精密	45,180	465,805.80	0.12
348	601958	金钼股份	52,100	460,564.00	0.12
349	300166	东方国信	49,600	457,312.00	0.12
350	688006	杭可科技	6,500	455,390.00	0.12
351	601106	中国一重	147,700	453,439.00	0.12
352	002390	信邦制药	65,500	452,605.00	0.12
353	601860	紫金银行	157,700	452,599.00	0.12
354	300888	稳健医疗	6,800	452,200.00	0.12
355	300072	三聚环保	88,600	448,316.00	0.12
356	600572	康恩贝	100,500	445,215.00	0.12
357	603927	中科软	19,040	444,012.80	0.12
358	600398	海澜之家	93,000	441,750.00	0.12
359	601118	海南橡胶	92,100	440,238.00	0.12
360	601718	际华集团	141,800	439,580.00	0.12
361	600507	方大特钢	62,771	438,769.29	0.12
362	000540	中天金融	226,300	436,759.00	0.12
363	600737	中粮糖业	57,500	432,400.00	0.11
364	600582	天地科技	89,100	425,898.00	0.11
365	603883	老百姓	12,562	425,600.56	0.11
366	000089	深圳机场	55,100	425,372.00	0.11
367	000937	冀中能源	57,000	425,220.00	0.11

368	000559	万向钱潮	71,100	422,334.00	0.11
369	002048	宁波华翔	26,300	421,326.00	0.11
370	002368	太极股份	21,779	418,374.59	0.11
371	600967	内蒙一机	45,800	417,696.00	0.11
372	000898	鞍钢股份	129,000	415,380.00	0.11
373	600435	北方导航	48,100	414,622.00	0.11
374	600871	石化油服	219,200	414,288.00	0.11
375	601000	唐山港	159,500	411,510.00	0.11
376	001914	招商积余	22,800	409,716.00	0.11
377	002690	美亚光电	18,860	408,884.80	0.11
378	601568	北元集团	64,140	406,647.60	0.11
379	002110	三钢闽光	66,000	401,940.00	0.11
380	600195	中牧股份	32,780	401,882.80	0.11
381	000959	首钢股份	84,200	400,792.00	0.11
382	600556	天下秀	48,600	399,978.00	0.11
383	601333	广深铁路	182,600	398,068.00	0.11
384	000156	华数传媒	49,900	397,703.00	0.11
385	002233	塔牌集团	44,900	397,365.00	0.11
386	002281	光迅科技	22,500	395,550.00	0.10
387	002705	新宝股份	17,800	391,422.00	0.10
388	688321	微芯生物	15,500	390,445.00	0.10
389	600811	东方集团	137,900	390,257.00	0.10
390	000537	广宇发展	30,000	389,700.00	0.10
391	003035	南网能源	61,100	387,985.00	0.10
392	002010	传化智联	60,300	387,729.00	0.10
393	600764	中国海防	15,300	386,172.00	0.10
394	002174	游族网络	39,400	384,938.00	0.10
395	000402	金融街	64,400	383,180.00	0.10
396	600329	达仁堂	15,400	378,532.00	0.10
397	600120	浙江东方	93,456	374,758.56	0.10
398	300212	易华录	21,400	372,360.00	0.10
399	600126	杭钢股份	72,700	372,224.00	0.10
400	002416	爱施德	40,000	372,000.00	0.10
401	000488	晨鸣纸业	65,900	371,676.00	0.10
402	000990	诚志股份	33,700	369,015.00	0.10
403	603638	艾迪精密	17,980	368,590.00	0.10
404	600167	联美控股	49,200	368,508.00	0.10
405	601200	上海环境	36,200	367,792.00	0.10
406	600446	金证股份	35,400	367,452.00	0.10
407	002867	周大生	23,600	366,508.00	0.10
408	000685	中山公用	47,600	365,568.00	0.10
409	601098	中南传媒	38,700	365,328.00	0.10

410	002081	金 螳 螂	71,900	365,252.00	0.10
411	002925	盈趣科技	16,900	363,688.00	0.10
412	600373	中文传媒	36,400	363,636.00	0.10
413	002382	蓝帆医疗	37,900	361,945.00	0.10
414	600707	彩虹股份	77,300	361,764.00	0.10
415	000158	常山北明	60,200	361,200.00	0.10
416	601611	中国核建	42,700	358,253.00	0.10
417	001965	招商公路	46,500	354,795.00	0.09
418	002146	荣盛发展	117,000	354,510.00	0.09
419	600095	湘财股份	46,100	354,509.00	0.09
420	601608	中信重工	93,400	353,986.00	0.09
421	002399	海普瑞	20,100	353,358.00	0.09
422	688029	南微医学	4,040	352,288.00	0.09
423	002387	维信诺	52,100	350,112.00	0.09
424	603317	天味食品	12,294	350,010.18	0.09
425	688088	虹软科技	11,000	347,490.00	0.09
426	000967	盈峰环境	68,400	346,104.00	0.09
427	600131	国网信通	25,700	345,665.00	0.09
428	002948	青岛银行	94,900	343,538.00	0.09
429	000528	柳 工	52,600	342,426.00	0.09
430	600376	首开股份	69,400	340,754.00	0.09
431	601187	厦门银行	56,800	338,528.00	0.09
432	600623	华谊集团	40,700	337,810.00	0.09
433	603000	人民网	29,800	333,760.00	0.09
434	000563	陕国投 A	106,700	332,904.00	0.09
435	002423	中粮资本	49,600	332,816.00	0.09
436	600901	江苏租赁	64,300	329,859.00	0.09
437	601598	中国外运	84,900	329,412.00	0.09
438	600307	酒钢宏兴	168,600	327,084.00	0.09
439	600006	东风汽车	43,000	324,650.00	0.09
440	601991	大唐发电	133,500	324,405.00	0.09
441	603228	景旺电子	13,720	320,087.60	0.08
442	300257	开山股份	21,300	318,648.00	0.08
443	000961	中南建设	102,900	313,845.00	0.08
444	600906	财达证券	34,900	313,751.00	0.08
445	603650	彤程新材	9,600	312,768.00	0.08
446	600717	天津港	77,924	312,475.24	0.08
447	002242	九阳股份	16,500	302,940.00	0.08
448	002434	万里扬	35,300	301,815.00	0.08
449	000718	苏宁环球	81,600	300,288.00	0.08
450	601928	凤凰传媒	41,100	293,865.00	0.08
451	000671	阳 光 城	133,700	292,803.00	0.08

452	000415	渤海租赁	133,200	289,044.00	0.08
453	000553	安道麦 A	23,400	283,374.00	0.08
454	600968	海油发展	109,400	282,252.00	0.07
455	601969	海南矿业	32,800	281,752.00	0.07
456	000031	大悦城	69,200	276,800.00	0.07
457	600648	外高桥	20,100	273,360.00	0.07
458	600787	中储股份	47,100	267,999.00	0.07
459	600928	西安银行	71,700	263,139.00	0.07
460	600339	中油工程	90,200	260,678.00	0.07
461	002563	森马服饰	43,400	256,928.00	0.07
462	601228	广州港	66,600	244,422.00	0.06
463	300869	康泰医学	8,600	243,036.00	0.06
464	002815	崇达技术	18,800	240,828.00	0.06
465	600835	上海机电	17,400	238,902.00	0.06
466	000028	国药一致	8,000	238,320.00	0.06
467	688819	天能股份	6,700	231,686.00	0.06
468	600377	宁沪高速	26,700	228,819.00	0.06
469	000717	韶钢松山	65,100	227,850.00	0.06
470	603056	德邦股份	16,605	223,005.15	0.06
471	002945	华林证券	14,500	221,125.00	0.06
472	603379	三美股份	9,840	218,940.00	0.06
473	000062	深圳华强	16,900	214,630.00	0.06
474	601139	深圳燃气	30,900	214,446.00	0.06
475	000869	张裕 A	7,200	214,128.00	0.06
476	600299	安迪苏	21,600	206,928.00	0.05
477	601298	青岛港	37,700	206,219.00	0.05
478	601869	长飞光纤	6,500	200,980.00	0.05
479	603868	飞科电器	2,600	196,950.00	0.05
480	001872	招商港口	12,200	190,320.00	0.05
481	002653	海思科	11,500	185,265.00	0.05
482	601156	东航物流	9,300	184,140.00	0.05
483	300741	华宝股份	6,500	180,830.00	0.05
484	600823	世茂股份	60,600	180,588.00	0.05
485	601828	美凯龙	29,200	176,952.00	0.05
486	600350	山东高速	33,600	176,400.00	0.05
487	600927	永安期货	8,500	171,445.00	0.05
488	001227	兰州银行	33,700	165,804.00	0.04
489	603355	莱克电气	6,100	153,903.00	0.04
490	603786	科博达	2,400	147,768.00	0.04
491	603515	欧普照明	8,000	139,600.00	0.04
492	001203	大中矿业	12,100	136,730.00	0.04
493	601665	齐鲁银行	27,100	132,248.00	0.04

494	603719	良品铺子	4,400	125,972.00	0.03
495	002946	新乳业	9,300	120,807.00	0.03
496	601003	柳钢股份	27,600	111,780.00	0.03
497	002901	大博医疗	2,500	97,850.00	0.03
498	600956	新天绿能	7,500	92,400.00	0.02
499	603983	丸美股份	2,900	77,720.00	0.02
500	600917	重庆燃气	9,200	66,424.00	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	301112	信邦智能	3,984	213,281.76	0.06
2	301175	中科环保	38,588	147,406.16	0.04
3	301239	普瑞眼科	4,071	136,989.15	0.04
4	688400	凌云光	5,967	130,856.31	0.03
5	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.03
6	688102	斯瑞新材	6,030	73,746.90	0.02
7	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
8	688267	中触媒	1,643	52,411.70	0.01
9	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
10	301238	瑞泰新材	996	31,941.72	0.01
11	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.01
12	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
13	301302	华如科技	302	17,038.84	0.00
14	301268	铭利达	472	16,458.64	0.00
15	301187	欧圣电气	730	16,454.20	0.00
16	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
17	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
18	301153	中科江南	343	15,085.14	0.00
19	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
20	301217	铜冠铜箔	971	14,399.93	0.00
21	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
22	301117	佳缘科技	240	13,065.60	0.00
23	301207	华兰疫苗	230	12,976.60	0.00
24	301206	三元生物	270	12,336.30	0.00
25	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
26	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
27	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
28	301200	大族数控	217	11,266.64	0.00
29	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
30	301219	腾远钴业	122	10,714.04	0.00
31	301151	冠龙节能	473	10,150.58	0.00

32	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
33	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
34	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
35	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
36	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
37	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
38	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
39	301110	青木股份	183	7,292.55	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	600096	云天化	2,167,197.00	0.55
2	300769	德方纳米	2,134,148.00	0.55
3	300012	华测检测	2,075,753.00	0.53
4	002497	雅化集团	1,996,181.00	0.51
5	002240	盛新锂能	1,946,418.00	0.50
6	300390	天华超净	1,660,607.00	0.42
7	002407	多氟多	1,659,191.06	0.42
8	688180	君实生物-U	1,635,644.69	0.42
9	300073	当升科技	1,527,453.00	0.39
10	002756	永兴材料	1,502,248.00	0.38
11	601058	赛轮轮胎	1,496,018.00	0.38
12	688122	西部超导	1,353,088.33	0.35
13	601108	财通证券	1,338,526.00	0.34
14	688777	中控技术	1,294,864.44	0.33
15	000783	长江证券	1,227,530.00	0.31
16	600499	科达制造	1,205,679.97	0.31
17	601696	中银证券	1,201,611.00	0.31
18	601162	天风证券	1,200,491.00	0.31
19	002625	光启技术	1,131,152.00	0.29
20	603345	安井食品	1,118,155.00	0.29

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	000733	振华科技	2,557,048.00	0.65
2	600188	兖矿能源	2,352,430.00	0.60
3	002340	格林美	2,194,777.00	0.56
4	601117	中国化学	1,949,278.00	0.50

5	300751	迈为股份	1,908,481.00	0.49
6	600884	杉杉股份	1,789,803.00	0.46
7	000723	美锦能源	1,738,985.00	0.44
8	688005	容百科技	1,721,626.37	0.44
9	605358	立昂微	1,567,752.40	0.40
10	601689	拓普集团	1,539,256.00	0.39
11	600754	锦江酒店	1,521,257.30	0.39
12	300763	锦浪科技	1,437,762.00	0.37
13	002013	中航机电	1,374,913.00	0.35
14	600733	北汽蓝谷	1,078,718.00	0.28
15	688536	思瑞浦	1,037,977.70	0.27
16	603290	斯达半导	1,031,276.00	0.26
17	300223	北京君正	1,000,916.00	0.26
18	600803	新奥股份	985,802.00	0.25
19	603893	瑞芯微	920,048.20	0.24
20	002080	中材科技	868,236.02	0.22

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	110,860,221.41
卖出股票收入（成交）总额	91,891,791.99

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特

殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 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	1,817,411.24
2	应收清算款	227,986.15
3	应收股利	66,073.16
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	9,518.14
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,120,988.69

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	600522	中天科技	796,950.00	0.21	转融通流通受限
2	601615	明阳智能	676,000.00	0.18	转融通流通受限
3	600096	云天化	472,200.00	0.13	转融通流通受限
4	002497	雅化集团	457,100.00	0.12	转融通流通受限
5	600256	广汇能源	382,602.00	0.10	转融通流通受限

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	301175	中科环保	132,664.78	0.04	新股未上市
1	301175	中科环保	14,741.38	0.00	新股流通受限
2	301239	普瑞眼科	123,259.95	0.03	新股未上市
2	301239	普瑞眼科	13,729.20	0.00	新股流通受限
3	688400	凌云光	130,856.31	0.03	新股未上市
4	688237	超卓航科	119,311.57	0.03	新股未上市
5	301112	信邦智能	17,970.96	0.00	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
12,728	19,658.33	68,111,887.00	27.22	182,099,366.00	72.78

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
----	----------	------------

中国工商银行股份有限公司-鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	58,114,837.00	23.23
--	---------------	-------

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	胡小彩	3,600,000.00	1.44
2	中信建投证券股份有限公司	2,860,057.00	1.14
3	招商证券股份有限公司	2,763,669.00	1.10
4	方正证券股份有限公司	2,659,185.00	1.06
5	魏丽君	2,105,200.00	0.84
6	段庆生	2,103,500.00	0.84
7	王雪有	2,000,000.00	0.80
8	于明中	1,986,700.00	0.79
9	金佳	1,826,400.00	0.73
10	秦珺	1,747,200.00	0.70
-	中国工商银行股份有限公司-鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	58,114,837.00	23.23

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截止本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 11 月 21 日）基金份额总额	490,211,253.00
本报告期期初基金份额总额	232,211,253.00
本报告期基金总申购份额	48,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	30,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	250,211,253.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司无重大人事变动。

基金托管人的重大人事变动：

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
平安证券	1	65,920,410.68	33.76	60,712.10	34.02	—
中金公司	1	55,843,173.42	28.60	50,976.03	28.57	—
兴业证券	1	54,982,024.29	28.16	50,633.79	28.38	—
国信证券	2	8,309,619.05	4.26	7,637.07	4.28	—

华西证券	1	4,331,069.77	2.22	3,536.04	1.98	—
国元证券	1	2,897,604.67	1.48	2,354.26	1.32	—
中泰证券	1	1,630,990.57	0.84	1,486.34	0.83	—
国盛证券	1	1,110,431.07	0.57	900.90	0.50	—
招商证券	1	217,595.77	0.11	198.29	0.11	—
东吴证券	1	—	—	—	—	—
国联证券	1	—	—	—	—	—
国泰君安	1	—	—	—	—	—
申万宏源 证券	2	—	—	—	—	—
世纪证券	1	—	—	—	—	—
西部证券	2	—	—	—	—	—
西南证券	1	—	—	—	—	—

注：交易单元选择的标准和程序：

1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的

需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性

及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	鹏华基金管理有限公司关于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	2022 年 01 月 01 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	《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	2022 年 01 月 01 日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加开源证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 14 日
4	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 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	2022 年 01 月 21 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华安证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 21 日
6	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 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	2022 年 03 月 30 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东吴证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 07 日
8	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 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	2022 年 04 月 21 日
9	鹏华基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	《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	2022 年 05 月 06 日
10	鹏华基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	《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	2022 年 05 月 13 日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京度小满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	2022 年 05 月 30 日

注：无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
------	----------------	------------

别	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20220101~20220630	51,373,737.00	26,391,100.00	19,650,000.00	58,114,837.00	23.23
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

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

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 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

2022 年 8 月 30 日