

鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF） 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	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产 (基金净值) 变动表	18
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63

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	63
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	63
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	63
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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	64
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末上市基金前十名持有人	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	66
§ 9 开放式基金份额变动	66
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 500 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	345,535,037.44 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)
下属分级基金的场 内简称	鹏华 500LOF	-
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	313,129,220.01 份	32,405,817.43 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

	<p>权重的变化进行相应调整。</p> <p>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。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 股票投资组合的构建</p> <p>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限度之内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p>(2) 股票投资组合的调整</p> <p>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。</p> <p>1) 定期调整</p> <p>根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。</p> <p>2) 不定期调整</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>(3) 存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>3、债券投资策略</p>
--	---

	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	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 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	
	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)
本期已实现收益	-14,010,589.80	-1,394,552.44

本期利润	-43,572,444.61	-16,184,433.42
加权平均基金份额本期利润	-0.1616	-0.4740
本期加权平均净值利润率	-9.53%	-25.45%
本期基金份额净值增长率	-10.14%	-10.32%
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	236,019,214.34	22,697,300.05
期末可供分配基金份额利润	0.7537	0.7004
期末基金资产净值	549,148,434.35	59,717,683.47
期末基金份额净值	1.754	1.843
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	75.40%	84.30%

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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

鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)

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

	率①	准差②		④		
过去一个月	7.61%	1.05%	6.74%	1.05%	0.87%	0.00%
过去三个月	2.99%	1.65%	1.99%	1.66%	1.00%	-0.01%
过去六个月	-10.14%	1.53%	-11.64%	1.55%	1.50%	-0.02%
过去一年	-1.41%	1.25%	-4.82%	1.26%	3.41%	-0.01%
过去三年	61.07%	1.28%	29.20%	1.28%	31.87%	0.00%
自基金合同生效起 至今	75.40%	1.58%	47.10%	1.55%	28.30%	0.03%

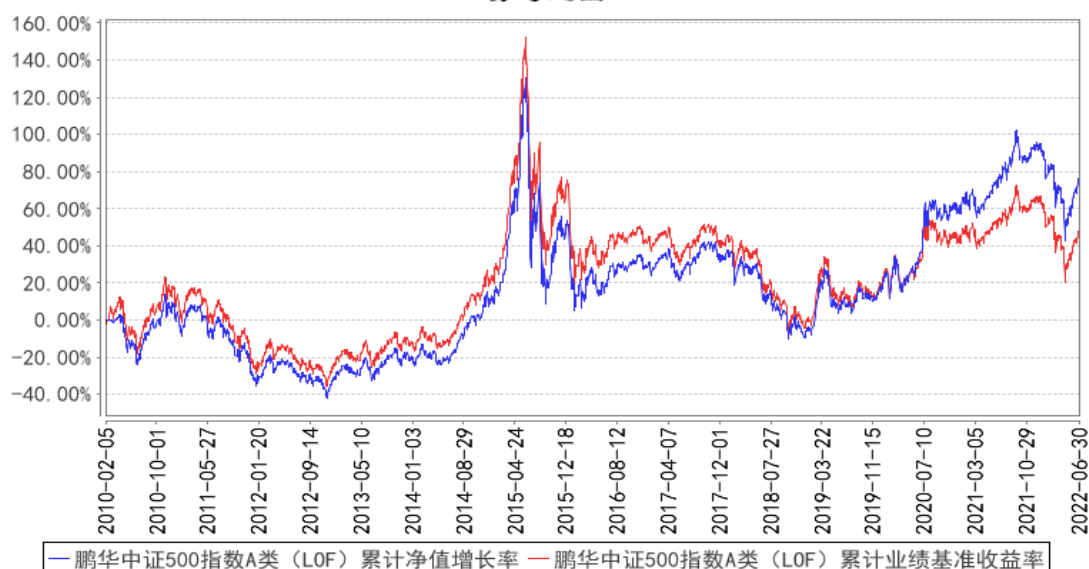
鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①-③	②-④
过去一个月	7.53%	1.04%	6.74%	1.05%	0.79%	-0.01%
过去三个月	2.96%	1.64%	1.99%	1.66%	0.97%	-0.02%
过去六个月	-10.32%	1.53%	-11.64%	1.55%	1.32%	-0.02%
过去一年	-1.60%	1.25%	-4.82%	1.26%	3.22%	-0.01%
过去三年	59.98%	1.28%	29.20%	1.28%	30.78%	0.00%
自基金合同生效起 至今	84.30%	1.35%	45.49%	1.35%	38.81%	0.00%

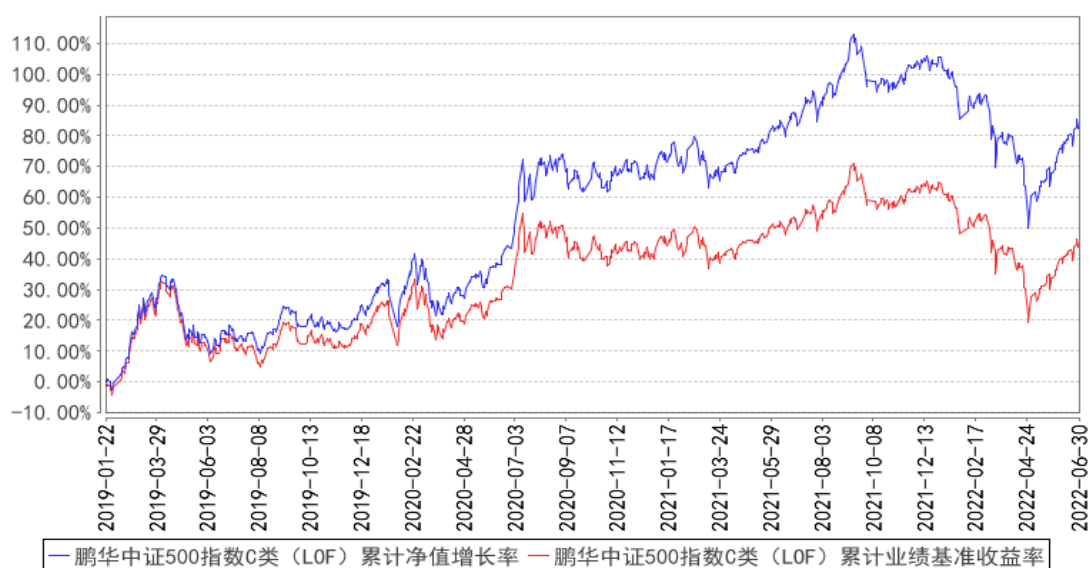
注：业绩比较基准=中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%

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

鹏华中证500指数A类 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鹏华中证500指数C类 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日, 业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末, 公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.)、深圳市北融信投资发展有限公司组成, 公司性质为中外合资企业, 公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末, 公司管理资产总规模达到 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		
张羽翔	基金经理	2016-09-24	-	15 年	张羽翔先生, 国籍中国, 工学硕士, 15 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。

3. 苏俊杰 2022 年 08 月 12 日新任本基金基金经理，张羽翔 2022 年 08 月 12 日离任本基金基金经理。

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，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 A 类份额净值增长率为-10.14%，同期业绩比较基准增长率为-11.64%，C 类份额净值增长率为-10.32%，同期业绩比较基准增长率为-11.64%。

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,特别是一季度 A 股市场经历了较大幅度的调整,3 月以来受俄乌局势紧张、美联储加息、中概股暴跌及国内疫情多地扩散等利空叠加的影响,市场出现非理性下杀。4 月新冠疫情致使市场悲观情绪再起,A 股市场继续下行,5 月虽然海外美股继续下跌,但 A 股却走出独立行情。随着稳增长政策不断加码、疫情本身和复工复产边际向好,市场信心逐步恢复。6 月疫情已经得到有效控制,助企纾困措施不断出台,市场信心和情绪不断回升,沪深三大指数震荡上行。

下半年宏观经济环境和货币政策依旧是影响 A 股走势的重要因素。宏观经济方面,国内稳增长政策持续发力下,经济增速较二季度将显著改善。估值方面,整体仍处于历史偏低水平。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末,本基金鹏华中证 500 指数 A 类(LOF)期末可供分配利润为 236,019,214.34 元,期末基金份额净值 1.754 元;鹏华中证 500 指数 C 类(LOF)期末可供分配利润为 22,697,300.05 元,期末基金份额净值 1.843 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 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 指数证券投资基金 (LOF)

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	35,423,998.82	32,390,528.17
结算备付金		476,286.17	338,120.38
存出保证金		206,083.21	129,853.02
交易性金融资产	6.4.7.2	569,835,587.99	507,915,051.41
其中：股票投资		569,835,587.99	507,915,051.41
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		8,704,494.86	1,548,389.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	3,296.19
资产总计		614,646,451.05	542,325,238.31
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		3,366,323.12	-
应付赎回款		1,565,833.58	1,489,095.07
应付管理人报酬		351,361.45	290,884.12
应付托管费		70,272.26	58,176.83
应付销售服务费		6,457.58	13,754.13
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	420,085.24	638,884.37
负债合计		5,780,333.23	2,490,794.52
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	345,535,037.44	272,359,058.06
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	263,331,080.38	267,475,385.73
净资产合计		608,866,117.82	539,834,443.79
负债和净资产总计		614,646,451.05	542,325,238.31

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额为 345,535,037.44 份，其中鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF) 基金份额总额为 313,129,220.01 份，基金份额净值 1.754 元；鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF) 基金份额总额为 32,405,817.43 份，基金份额净值 1.843 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：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		-57,178,144.88	36,970,528.16
1. 利息收入		98,022.17	37,418.62
其中：存款利息收入	6.4.7.13	98,022.17	37,418.62
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）		-12,991,818.05	41,014,648.06
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-19,068,109.86	38,244,065.98
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	6,076,291.81	2,770,582.08
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	-44,351,735.79	-4,198,095.25
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	67,386.79	116,556.73
减：二、营业总支出		2,578,733.15	2,381,285.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,939,075.89	1,189,058.89
2. 托管费	6.4.10.2.2	387,815.19	237,811.79
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	67,141.05	32,764.75
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			-	-
8. 其他费用	6.4.7.23		184,701.02	921,650.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）			-59,756,878.03	34,589,242.60
减：所得税费用			-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）			-59,756,878.03	34,589,242.60
五、其他综合收益的税后净额			-	-
六、综合收益总额			-59,756,878.03	34,589,242.60

6.3 净资产（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：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)	272,359,058.06	-	267,475,385.73	539,834,443.79
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)	272,359,058.06	-	267,475,385.73	539,834,443.79
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	73,175,979.38	-	-4,144,305.35	69,031,674.03
(一)、综合收	-	-	-59,756,878.03	-59,756,878.03

益总额				
(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)	73,175,979.38	-	55,612,572.68	128,788,552.06
其中:1. 基金申购款	369,415,412.67	-	310,834,722.88	680,250,135.55
2. 基金赎回款	-296,239,433.29	-	-255,222,150.20	-551,461,583.49
(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)	345,535,037.44	-	263,331,080.38	608,866,117.82
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	198,691,003.01	-	123,974,847.21	322,665,850.22

金净值)				
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)	198,691,003.01	-	123,974,847.21	322,665,850.22
三、本 期 增 减 变 动 额 (减 少 以 “- ” 号 填 列)	33,980,289.50	-	62,214,918.59	96,195,208.09
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	34,589,242.60	34,589,242.60
(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)	33,980,289.50	-	27,625,675.99	61,605,965.49
其中:1. 基 金 申 购 款	187,071,641.02	-	136,883,161.26	323,954,802.28
2 .基 金 赎 回 款	-153,091,351.52	-	-109,257,485.27	-262,348,836.79
(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、本期末净资产(基金净值)	232,671,292.51	-	186,189,765.80	418,861,058.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

邢彪

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]第 1374 号《关于核准鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,629,831,732.31 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 021 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2010 年 2 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,630,723,634.12 份基金份额,其中认购资金利息折合 891,901.81 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2010]第 129 号文审核同意,本基金 583,423,342.00 份基金份额于 2010 年 4 月 28 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，中证 500 指数的成份股及其备选成份股（含存托凭证）（投资比例不低于基金资产净值的 90%），现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，为更好的实现投资目标，本基金将少量投资于非中证 500 成份股（含存托凭证）、新股（含存托凭证）（首次发行或增发等）以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率 X95%+银行同业存款利率 X5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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、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 3,085.69 元、152.10 元、58.40 元、-3,296.19 元、-415,353.97 元和 415,353.97 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	35,423,998.82
等于: 本金	35,420,721.86
加: 应计利息	3,276.96
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	35,423,998.82

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	588,363,427.36	-	569,835,587.99	-18,527,839.37
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	588,363,427.36	-	569,835,587.99	-18,527,839.37

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

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

注：无。

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	3,278.02
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	282,504.66
其中：交易所市场	282,504.66
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	50,000.00
合计	420,085.24

6.4.7.10 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 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	192,963,543.71	192,963,543.71
本期申购	152,933,238.62	152,933,238.62
本期赎回 (以“-”号填列)	-32,767,562.32	-32,767,562.32
-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	313,129,220.01	313,129,220.01

鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)

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	79,395,514.35	79,395,514.35
本期申购	216,482,174.05	216,482,174.05
本期赎回 (以“-”号填列)	-263,471,870.97	-263,471,870.97
-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	32,405,817.43	32,405,817.43

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

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

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
本期期初	276,853,890.73	-93,114,319.78	183,739,570.95
本期利润	-14,010,589.80	-29,561,854.81	-43,572,444.61
本期基金份额交易产生的变动数	169,835,448.62	-73,983,360.62	95,852,088.00
其中：基金申购款	216,122,170.25	-96,209,346.89	119,912,823.36
基金赎回款	-46,286,721.63	22,225,986.27	-24,060,735.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	432,678,749.55	-196,659,535.21	236,019,214.34

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
本期期初	60,257,087.53	23,478,727.25	83,735,814.78
本期利润	-1,394,552.44	-14,789,880.98	-16,184,433.42
本期基金份额交易产生的变动数	-36,165,235.04	-4,074,280.28	-40,239,515.32
其中：基金申购款	161,327,532.33	29,594,367.19	190,921,899.52
基金赎回款	-197,492,767.37	-33,668,647.47	-231,161,414.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,697,300.05	4,614,565.99	27,311,866.04

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	65,775.67
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	7,570.57
其他	24,675.93
合计	98,022.17

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	-19,068,109.86
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	-19,068,109.86

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	455,068,675.17
减：卖出股票成本总额	472,626,129.31
减：交易费用	1,510,655.72
买卖股票差价收入	-19,068,109.86

6.4.7.14.3 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

注：无。

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	6,076,291.81
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	6,076,291.81

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	-44,351,735.79
股票投资	-44,351,735.79
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	-44,351,735.79

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	66,516.34
基金转换费收入	870.45
合计	67,386.79

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	372.00
指数使用费	100,000.00
存托服务费	26.46

合计	184,701.02
----	------------

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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	72,067,771.01	7.03	100,294,262.43	21.25

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	67,088.15	7.09	11,171.53	3.95
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	93,060.41	21.41	70,490.08	23.82

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	1,939,075.89	1,189,058.89
其中：支付销售机构的客户维护费	459,101.69	443,378.16

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.75%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.75%÷当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	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	387,815.19	237,811.79

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)	合计
国信证券	-	6.38	6.38
鹏华基金公司	-	5,604.38	5,604.38
合计	-	5,610.76	5,610.76
获得销售服务费的各关联方名称	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
国信证券	-	-	-
鹏华基金公司	-	5,972.85	5,972.85
合计	-	5,972.85	5,972.85

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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	35,423,998.82	65,775.67	27,316,124.26	34,422.23

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。

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
-	-	-	-	-	-
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	1,975	93,476.75

注：无。

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	180	11,358.00	7,173.00	-
301112	信邦智能	2022 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
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	262	12,261.60	14,263.28	-
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	698	21,512.36	14,979.08	-
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通受限	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
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	54,362	207,662.84	207,662.84	-
301175	中科环保	2022年6月30日	6个月	新股流通受限	3.82	3.82	6,041	23,076.62	23,076.62	-
301187	欧圣电气	2022年4月13日	6个月	新股流通受限	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	240	18,374.40	12,460.80	-
301206	三元生物	2022年1月26日	6个月	新股流通受限	109.30	45.69	354	25,794.80	16,174.26	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	322	18,315.36	18,167.24	-
301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	新股流通受限	17.27	14.83	1,337	23,089.99	19,827.71	-
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	1,547	29,671.46	49,612.29	-
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	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
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	641	18,268.50	22,351.67	-
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	460	23,933.80	25,953.20	-
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	-

		日								
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	6 个月	新股流 通受限	21.93	21.93	9,358	205,220.94	205,220.94	-

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

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

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

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

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

6.4.12.2 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 7 月 14 日	9.99	105,520	986,807.01	1,012,992.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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 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 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。

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	35,423,998.82	-	-	-	35,423,998.82
结算备付金	476,286.17	-	-	-	476,286.17
存出保证金	206,083.21	-	-	-	206,083.21
交易性金融资产	-	-	-	569,835,587.99	569,835,587.99
应收申购款	-	-	-	8,704,494.86	8,704,494.86
资产总计	36,106,368.20	-	-	578,540,082.85	614,646,451.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,565,833.58	1,565,833.58
应付管理人报酬	-	-	-	351,361.45	351,361.45
应付托管费	-	-	-	70,272.26	70,272.26
应付清算款	-	-	-	3,366,323.12	3,366,323.12
应付销售服务费	-	-	-	6,457.58	6,457.58
其他负债	-	-	-	420,085.24	420,085.24
负债总计	-	-	-	5,780,333.23	5,780,333.23
利率敏感度缺口	36,106,368.20	-	-	-572,759,749.62	608,866,117.82
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	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
应收申购款	-	-	-	1,548,389.14	1,548,389.14
其他资产	-	-	-	3,296.19	3,296.19
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
其他负债	-	-	-	638,884.37	638,884.37
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

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。

本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股，其投资比例不低于基金资产净值的 90%。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，

及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	569,835,587.99	93.59	507,915,051.41	94.09
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	569,835,587.99	93.59	507,915,051.41	94.09

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%	28,604,530.22	25,480,185.75
	业绩比较基准下降5%	-28,604,530.22	-25,480,185.75

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	567,543,964.09
第二层次	1,827,086.04
第三层次	464,537.86
合计	569,835,587.99

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	569,835,587.99	92.71
	其中：股票	569,835,587.99	92.71
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	35,900,284.99	5.84
8	其他各项资产	8,910,578.07	1.45
9	合计	614,646,451.05	100.00

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：2,188,821.50 元，占净值比 0.36%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

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	5,289,792.24	0.87
B	采矿业	25,578,089.05	4.20
C	制造业	336,461,151.33	55.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,777,215.32	2.92
E	建筑业	7,432,060.00	1.22
F	批发和零售业	22,299,671.75	3.66
G	交通运输、仓储和邮政业	15,360,075.56	2.52
H	住宿和餐饮业	1,215,200.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,286,957.21	6.95
J	金融业	50,617,253.17	8.31
K	房地产业	13,534,820.55	2.22
L	租赁和商务服务业	7,003,883.00	1.15

M	科学研究和技术服务业	5,915,471.00	0.97
N	水利、环境和公共设施管理业	4,189,931.83	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,316,152.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	7,625,744.00	1.25
S	综合	4,241,436.71	0.70
	合计	568,144,904.72	93.31

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	910,133.24	0.15
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	336,791.18	0.06
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	242,785.48	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	193,386.55	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,690,683.27	0.28

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	239,300	5,527,830.00	0.91
2	601615	明阳智能	144,300	4,877,340.00	0.80
3	600256	广汇能源	403,000	4,247,620.00	0.70
4	002497	雅化集团	97,600	3,186,640.00	0.52
5	002407	多氟多	64,600	3,159,586.00	0.52
6	002180	纳思达	61,900	3,133,378.00	0.51
7	600157	永泰能源	1,949,700	3,100,023.00	0.51
8	002240	盛新锂能	51,100	3,084,396.00	0.51
9	000009	中国宝安	226,480	3,055,215.20	0.50
10	600885	宏发股份	72,712	3,042,997.20	0.50
11	300390	天华超净	34,800	3,041,520.00	0.50
12	600141	兴发集团	68,118	2,996,510.82	0.49
13	600392	盛和资源	122,729	2,773,675.40	0.46
14	002384	东山精密	119,700	2,744,721.00	0.45
15	300073	当升科技	29,900	2,701,166.00	0.44
16	603613	国联股份	30,205	2,676,163.00	0.44
17	600418	江淮汽车	152,468	2,616,350.88	0.43
18	002756	永兴材料	17,000	2,587,570.00	0.42
19	300285	国瓷材料	70,200	2,521,584.00	0.41
20	600765	中航重机	77,293	2,487,288.74	0.41
21	600399	抚顺特钢	138,100	2,471,990.00	0.41
22	600233	圆通速递	120,400	2,454,956.00	0.40
23	601555	东吴证券	351,180	2,433,677.40	0.40
24	600487	亨通光电	165,600	2,407,824.00	0.40
25	600563	法拉电子	11,723	2,405,090.68	0.40
26	000983	山西焦煤	179,490	2,403,371.10	0.39
27	300037	新宙邦	45,420	2,387,275.20	0.39
28	601058	赛轮轮胎	207,700	2,340,779.00	0.38
29	600732	爱旭股份	70,300	2,321,306.00	0.38
30	603077	和邦生物	542,380	2,310,538.80	0.38
31	600499	科达制造	111,700	2,305,488.00	0.38
32	002385	大北农	290,400	2,268,024.00	0.37
33	300012	华测检测	97,600	2,265,296.00	0.37
34	603456	九洲药业	43,500	2,248,950.00	0.37
35	002268	卫士通	51,780	2,221,879.80	0.36
36	688180	君实生物-U	29,330	2,209,722.20	0.36
37	300363	博腾股份	28,200	2,199,318.00	0.36

38	689009	九号公司-WD	49,187	2,188,821.50	0.36
39	688099	晶晨股份	21,473	2,168,773.00	0.36
40	601108	财通证券	275,400	2,167,398.00	0.36
41	688122	西部超导	23,420	2,159,324.00	0.35
42	600486	扬农化工	16,000	2,132,480.00	0.35
43	000519	中兵红箭	73,108	2,131,098.20	0.35
44	600298	安琪酵母	43,600	2,125,500.00	0.35
45	000630	铜陵有色	646,700	2,108,242.00	0.35
46	603345	安井食品	12,300	2,064,801.00	0.34
47	600862	中航高科	73,300	2,059,730.00	0.34
48	000988	华工科技	88,050	2,040,118.50	0.34
49	300144	宋城演艺	132,600	2,035,410.00	0.33
50	002353	杰瑞股份	50,000	2,015,000.00	0.33
51	601077	渝农商行	542,100	2,005,770.00	0.33
52	603605	珀莱雅	12,000	1,982,160.00	0.33
53	601168	西部矿业	167,000	1,975,610.00	0.32
54	000783	长江证券	328,000	1,945,040.00	0.32
55	300146	汤臣倍健	88,700	1,920,355.00	0.32
56	002028	思源电气	53,324	1,901,533.84	0.31
57	002056	横店东磁	71,108	1,892,894.96	0.31
58	002625	光启技术	109,400	1,889,338.00	0.31
59	002797	第一创业	294,600	1,888,386.00	0.31
60	601696	中银证券	141,200	1,877,960.00	0.31
61	300724	捷佳伟创	21,000	1,876,350.00	0.31
62	601162	天风证券	587,600	1,868,568.00	0.31
63	002507	涪陵榨菜	53,904	1,860,766.08	0.31
64	600988	赤峰黄金	116,600	1,859,770.00	0.31
65	000932	华菱钢铁	363,460	1,850,011.40	0.30
66	002185	华天科技	196,400	1,842,232.00	0.30
67	688777	中控技术	25,286	1,839,809.36	0.30
68	601128	常熟银行	240,200	1,835,128.00	0.30
69	603589	口子窖	31,200	1,828,632.00	0.30
70	601636	旗滨集团	141,200	1,800,300.00	0.30
71	603517	绝味食品	30,900	1,786,638.00	0.29
72	600521	华海药业	78,300	1,777,410.00	0.29
73	002603	以岭药业	73,060	1,775,358.00	0.29
74	600039	四川路桥	167,050	1,759,036.50	0.29
75	000830	鲁西化工	100,827	1,743,298.83	0.29
76	002078	太阳纸业	141,228	1,738,516.68	0.29
77	603026	石大胜华	11,900	1,729,665.00	0.28
78	002326	永太科技	51,800	1,705,774.00	0.28
79	600153	建发股份	130,200	1,701,714.00	0.28

80	600109	国金证券	189,000	1,701,000.00	0.28
81	601607	上海医药	93,900	1,697,712.00	0.28
82	600546	山煤国际	86,800	1,689,128.00	0.28
83	605117	德业股份	6,000	1,679,340.00	0.28
84	002624	完美世界	114,800	1,649,676.00	0.27
85	603267	鸿远电子	12,200	1,638,826.00	0.27
86	601872	招商轮船	284,500	1,638,720.00	0.27
87	002422	科伦药业	87,000	1,626,900.00	0.27
88	600705	中航产融	469,200	1,623,432.00	0.27
89	600497	驰宏锌锗	312,600	1,622,394.00	0.27
90	600348	华阳股份	104,800	1,620,208.00	0.27
91	000738	航发控制	57,600	1,618,560.00	0.27
92	600177	雅戈尔	243,400	1,613,742.00	0.27
93	600549	厦门钨业	74,500	1,610,690.00	0.26
94	600875	东方电气	97,300	1,600,585.00	0.26
95	300088	长信科技	215,200	1,596,784.00	0.26
96	000970	中科三环	85,025	1,596,769.50	0.26
97	300699	光威复材	27,000	1,589,490.00	0.26
98	603939	益丰药房	30,000	1,584,900.00	0.26
99	688390	固德威	5,040	1,577,570.40	0.26
100	601990	南京证券	187,300	1,562,082.00	0.26
101	600160	巨化股份	118,280	1,555,382.00	0.26
102	000831	五矿稀土	49,700	1,553,125.00	0.26
103	603127	昭衍新药	13,600	1,547,680.00	0.25
104	000999	华润三九	34,300	1,543,500.00	0.25
105	000998	隆平高科	92,304	1,537,784.64	0.25
106	600859	王府井	59,149	1,536,691.02	0.25
107	002673	西部证券	234,800	1,535,592.00	0.25
108	002138	顺络电子	56,200	1,531,450.00	0.25
109	601699	潞安环能	104,500	1,527,790.00	0.25
110	002572	索菲亚	55,500	1,526,250.00	0.25
111	600516	方大炭素	200,100	1,520,760.00	0.25
112	000807	云铝股份	152,100	1,502,748.00	0.25
113	002557	洽洽食品	26,300	1,497,259.00	0.25
114	600372	中航电子	77,200	1,496,908.00	0.25
115	000039	中集集团	107,520	1,489,152.00	0.24
116	600482	中国动力	94,500	1,484,595.00	0.24
117	002508	老板电器	41,200	1,484,436.00	0.24
118	300676	华大基因	20,600	1,477,020.00	0.24
119	002030	达安基因	85,888	1,476,414.72	0.24
120	000960	锡业股份	87,600	1,469,052.00	0.24
121	002465	海格通信	161,400	1,467,126.00	0.24

122	002273	水晶光电	121,084	1,466,327.24	0.24
123	601997	贵阳银行	251,100	1,458,891.00	0.24
124	600143	金发科技	152,400	1,450,848.00	0.24
125	000629	攀钢钒钛	377,000	1,432,600.00	0.24
126	000728	国元证券	229,300	1,426,246.00	0.23
127	300058	蓝色光标	218,200	1,424,846.00	0.23
128	300136	信维通信	84,500	1,423,825.00	0.23
129	000975	银泰黄金	146,020	1,422,234.80	0.23
130	300357	我武生物	27,200	1,415,216.00	0.23
131	600170	上海建工	466,700	1,414,101.00	0.23
132	600536	中国软件	34,650	1,406,443.50	0.23
133	600704	物产中大	273,200	1,401,516.00	0.23
134	603444	吉比特	3,600	1,396,800.00	0.23
135	002409	雅克科技	24,900	1,382,199.00	0.23
136	601577	长沙银行	173,900	1,379,027.00	0.23
137	002092	中泰化学	176,568	1,370,167.68	0.23
138	600739	辽宁成大	93,500	1,363,230.00	0.22
139	002294	信立泰	48,300	1,357,230.00	0.22
140	603198	迎驾贡酒	20,700	1,348,398.00	0.22
141	002223	鱼跃医疗	52,405	1,344,712.30	0.22
142	000547	航天发展	112,400	1,342,056.00	0.22
143	600415	小商品城	240,600	1,340,142.00	0.22
144	300418	昆仑万维	83,700	1,339,200.00	0.22
145	002506	协鑫集成	359,600	1,337,712.00	0.22
146	300474	景嘉微	19,500	1,333,605.00	0.22
147	002739	万达电影	97,600	1,332,240.00	0.22
148	002372	伟星新材	55,320	1,329,892.80	0.22
149	600079	人福医药	82,700	1,323,200.00	0.22
150	300253	卫宁健康	150,500	1,321,390.00	0.22
151	300244	迪安诊断	42,320	1,316,152.00	0.22
152	600699	均胜电子	83,760	1,315,869.60	0.22
153	000636	风华高科	69,300	1,302,147.00	0.21
154	300308	中际旭创	41,900	1,300,995.00	0.21
155	300296	利亚德	178,100	1,300,130.00	0.21
156	600637	东方明珠	179,300	1,281,995.00	0.21
157	600867	通化东宝	122,900	1,270,786.00	0.21
158	300558	贝达药业	20,900	1,270,720.00	0.21
159	300769	德方纳米	3,100	1,266,908.00	0.21
160	601016	节能风电	263,800	1,266,240.00	0.21
161	600236	桂冠电力	207,300	1,262,457.00	0.21
162	600985	淮北矿业	86,700	1,262,352.00	0.21
163	000887	中鼎股份	69,100	1,260,384.00	0.21

164	601198	东兴证券	141,400	1,258,460.00	0.21
165	600026	中远海能	121,756	1,257,739.48	0.21
166	600315	上海家化	29,413	1,257,405.75	0.21
167	002156	通富微电	81,300	1,252,020.00	0.21
168	002299	圣农发展	65,200	1,250,536.00	0.21
169	600171	上海贝岭	49,562	1,240,536.86	0.20
170	600879	航天电子	190,600	1,236,994.00	0.20
171	600380	健康元	99,948	1,234,357.80	0.20
172	002683	广东宏大	44,200	1,230,086.00	0.20
173	600642	申能股份	215,200	1,222,336.00	0.20
174	600258	首旅酒店	49,000	1,215,200.00	0.20
175	300026	红日药业	157,700	1,214,290.00	0.20
176	002936	郑州银行	450,857	1,212,805.33	0.20
177	000750	国海证券	334,080	1,212,710.40	0.20
178	002408	齐翔腾达	149,013	1,208,495.43	0.20
179	002065	东华软件	191,100	1,207,752.00	0.20
180	000623	吉林敖东	81,300	1,199,988.00	0.20
181	002203	海亮股份	103,300	1,193,115.00	0.20
182	000729	燕京啤酒	123,200	1,190,112.00	0.20
183	603233	大参林	38,020	1,190,026.00	0.20
184	600673	东阳光	131,949	1,186,221.51	0.19
185	300677	英科医疗	46,760	1,185,833.60	0.19
186	300832	新产业	26,200	1,181,882.00	0.19
187	000513	丽珠集团	32,420	1,173,928.20	0.19
188	600820	隧道股份	191,400	1,171,368.00	0.19
189	600096	云天化	37,100	1,167,908.00	0.19
190	600038	中直股份	25,700	1,161,640.00	0.19
191	601717	郑煤机	80,605	1,161,518.05	0.19
192	600580	卧龙电驱	80,486	1,160,608.12	0.19
193	600529	山东药玻	41,500	1,159,925.00	0.19
194	600801	华新水泥	59,330	1,157,528.30	0.19
195	000878	云南铜业	101,600	1,157,224.00	0.19
196	002439	启明星辰	58,000	1,155,940.00	0.19
197	000400	许继电气	60,200	1,155,840.00	0.19
198	600369	西南证券	291,100	1,155,667.00	0.19
199	002131	利欧股份	592,540	1,149,527.60	0.19
200	300017	网宿科技	214,400	1,149,184.00	0.19
201	300383	光环新网	110,100	1,147,242.00	0.19
202	002183	怡亚通	159,000	1,146,390.00	0.19
203	600166	福田汽车	404,100	1,143,603.00	0.19
204	603568	伟明环保	34,119	1,138,551.03	0.19
205	002444	巨星科技	60,095	1,132,189.80	0.19

206	600316	洪都航空	37,400	1,130,976.00	0.19
207	002195	二三四五	501,821	1,129,097.25	0.19
208	600027	华电国际	285,900	1,123,587.00	0.18
209	601005	重庆钢铁	588,100	1,123,271.00	0.18
210	600909	华安证券	246,850	1,123,167.50	0.18
211	002958	青农商行	338,200	1,122,824.00	0.18
212	600325	华发股份	147,975	1,120,170.75	0.18
213	600008	首创环保	386,130	1,119,777.00	0.18
214	688185	康希诺	5,600	1,114,848.00	0.18
215	600848	上海临港	80,800	1,095,648.00	0.18
216	300024	机器人	108,300	1,091,664.00	0.18
217	688256	寒武纪-U	16,849	1,090,130.30	0.18
218	000825	太钢不锈	199,600	1,087,820.00	0.18
219	300618	寒锐钴业	18,700	1,083,104.00	0.18
220	002500	山西证券	188,570	1,082,391.80	0.18
221	002926	华西证券	137,900	1,081,136.00	0.18
222	002373	千方科技	96,814	1,076,571.68	0.18
223	002430	杭氧股份	34,400	1,075,344.00	0.18
224	300001	特锐德	62,000	1,073,220.00	0.18
225	603218	日月股份	42,200	1,071,880.00	0.18
226	000050	深天马 A	107,500	1,071,775.00	0.18
227	000027	深圳能源	166,600	1,067,906.00	0.18
228	688521	芯原股份-U	21,575	1,065,805.00	0.18
229	600271	航天信息	97,200	1,063,368.00	0.17
230	000739	普洛药业	51,400	1,060,896.00	0.17
231	002250	联化科技	64,449	1,055,030.13	0.17
232	002212	天融信	103,800	1,053,570.00	0.17
233	600863	内蒙华电	286,200	1,044,630.00	0.17
234	601866	中远海发	347,500	1,042,500.00	0.17
235	600208	新湖中宝	376,900	1,040,244.00	0.17
236	600118	中国卫星	51,600	1,036,128.00	0.17
237	000060	中金岭南	229,200	1,022,232.00	0.17
238	002985	北摩高科	17,373	1,017,710.34	0.17
239	002249	大洋电机	165,750	1,017,705.00	0.17
240	002670	国盛金控	105,520	1,012,992.00	0.17
241	601992	金隅集团	365,500	1,012,435.00	0.17
242	300009	安科生物	100,072	1,011,727.92	0.17
243	000778	新兴铸管	209,900	1,011,718.00	0.17
244	600066	宇通客车	116,600	1,008,590.00	0.17
245	002152	广电运通	108,500	1,005,795.00	0.17
246	603156	养元饮品	43,900	997,408.00	0.16
247	688009	中国通号	219,242	993,166.26	0.16

248	300182	捷成股份	180,200	991,100.00	0.16
249	300070	碧水源	190,200	990,942.00	0.16
250	300168	万达信息	103,900	980,816.00	0.16
251	002966	苏州银行	160,480	978,928.00	0.16
252	603858	步长制药	49,600	977,616.00	0.16
253	000401	冀东水泥	92,900	977,308.00	0.16
254	600998	九州通	81,900	975,429.00	0.16
255	600755	厦门国贸	129,713	972,847.50	0.16
256	300251	光线传媒	102,600	971,622.00	0.16
257	002191	劲嘉股份	90,024	965,057.28	0.16
258	600390	五矿资本	197,100	963,819.00	0.16
259	002128	电投能源	67,100	960,872.00	0.16
260	600970	中材国际	99,150	960,763.50	0.16
261	603658	安图生物	19,500	953,355.00	0.16
262	002831	裕同科技	32,260	953,283.00	0.16
263	000021	深科技	81,856	952,803.84	0.16
264	600667	太极实业	129,000	952,020.00	0.16
265	000997	新大陆	71,986	950,935.06	0.16
266	002505	鹏都农牧	279,370	947,064.30	0.16
267	300482	万孚生物	23,150	942,436.50	0.15
268	002221	东华能源	100,918	939,546.58	0.15
269	600528	中铁工业	116,500	937,825.00	0.15
270	600839	四川长虹	323,800	932,544.00	0.15
271	600056	中国医药	62,912	932,355.84	0.15
272	600062	华润双鹤	36,312	931,765.92	0.15
273	600021	上海电力	90,900	931,725.00	0.15
274	600297	广汇汽车	355,900	928,899.00	0.15
275	600827	百联股份	70,100	926,021.00	0.15
276	688002	睿创微纳	23,305	925,674.60	0.15
277	000987	越秀金控	131,580	925,007.40	0.15
278	002244	滨江集团	106,792	923,750.80	0.15
279	603885	吉祥航空	51,300	922,887.00	0.15
280	600598	北大荒	62,300	919,548.00	0.15
281	002127	南极电商	171,900	917,946.00	0.15
282	002396	星网锐捷	40,500	916,920.00	0.15
283	603707	健友股份	32,430	914,526.00	0.15
284	000656	金科股份	319,200	912,912.00	0.15
285	002019	亿帆医药	64,700	904,506.00	0.15
286	600155	华创阳安	106,400	902,272.00	0.15
287	002266	浙富控股	188,240	901,669.60	0.15
288	600201	生物股份	98,338	900,776.08	0.15
289	600498	烽火通信	62,200	900,656.00	0.15

290	002155	湖南黄金	73,700	894,718.00	0.15
291	000012	南玻A	120,338	892,907.96	0.15
292	600409	三友化工	108,502	888,631.38	0.15
293	600259	广晟有色	17,531	887,945.15	0.15
294	000930	中粮科技	97,947	885,440.88	0.15
295	000883	湖北能源	172,800	883,008.00	0.15
296	600511	国药股份	32,592	872,813.76	0.14
297	600718	东软集团	75,800	872,458.00	0.14
298	002153	石基信息	54,940	871,897.80	0.14
299	002124	天邦食品	128,780	865,401.60	0.14
300	002511	中顺洁柔	69,000	863,880.00	0.14
301	600060	海信视像	68,700	858,750.00	0.14
302	000686	东北证券	122,800	858,372.00	0.14
303	600282	南钢股份	270,000	850,500.00	0.14
304	600959	江苏有线	260,600	849,556.00	0.14
305	603712	七一二	26,900	847,350.00	0.14
306	600782	新钢股份	167,400	843,696.00	0.14
307	000581	威孚高科	43,800	843,150.00	0.14
308	601880	辽港股份	495,322	842,047.40	0.14
309	000709	河钢股份	372,400	841,624.00	0.14
310	601179	中国西电	179,600	840,528.00	0.14
311	600895	张江高科	67,500	840,375.00	0.14
312	600566	济川药业	30,900	839,244.00	0.14
313	000690	宝新能源	190,660	835,090.80	0.14
314	600022	山东钢铁	479,850	834,939.00	0.14
315	600064	南京高科	75,522	830,742.00	0.14
316	600535	天士力	78,500	825,035.00	0.14
317	002939	长城证券	81,200	824,992.00	0.14
318	300376	易事特	101,300	822,556.00	0.14
319	002701	奥瑞金	157,653	819,795.60	0.13
320	002002	鸿达兴业	218,938	812,259.98	0.13
321	600216	浙江医药	59,000	805,350.00	0.13
322	600500	中化国际	121,100	805,315.00	0.13
323	600808	马钢股份	211,800	802,722.00	0.13
324	000598	兴蓉环境	156,700	800,737.00	0.13
325	600037	歌华有线	85,100	799,089.00	0.13
326	688188	柏楚电子	3,630	798,745.20	0.13
327	002532	天山铝业	122,300	798,619.00	0.13
328	300630	普利制药	22,640	795,796.00	0.13
329	600663	陆家嘴	76,800	795,648.00	0.13
330	600728	佳都科技	122,900	793,934.00	0.13
331	002468	申通快递	66,500	792,680.00	0.13

332	601778	晶科科技	146,700	792,180.00	0.13
333	600567	山鹰国际	283,400	785,018.00	0.13
334	688208	道通科技	23,752	781,915.84	0.13
335	600517	国网英大	150,200	779,538.00	0.13
336	002595	豪迈科技	34,700	775,198.00	0.13
337	002004	华邦健康	138,635	773,583.30	0.13
338	603866	桃李面包	46,489	769,392.95	0.13
339	603225	新凤鸣	66,620	768,794.80	0.13
340	601456	国联证券	62,500	766,875.00	0.13
341	300463	迈克生物	37,200	762,228.00	0.13
342	002745	木林森	77,800	760,106.00	0.12
343	600597	光明乳业	60,100	759,063.00	0.12
344	300115	长盈精密	73,502	757,805.62	0.12
345	002429	兆驰股份	197,300	757,632.00	0.12
346	688289	圣湘生物	25,470	754,166.70	0.12
347	688029	南微医学	8,600	749,920.00	0.12
348	601958	金钼股份	84,700	748,748.00	0.12
349	601106	中国一重	240,500	738,335.00	0.12
350	000785	居然之家	165,700	737,365.00	0.12
351	002390	信邦制药	106,300	734,533.00	0.12
352	300166	东方国信	79,119	729,477.18	0.12
353	601860	紫金银行	253,800	728,406.00	0.12
354	688006	杭可科技	10,340	724,420.40	0.12
355	600572	康恩贝	163,477	724,203.11	0.12
356	603927	中科软	30,880	720,121.60	0.12
357	601118	海南橡胶	149,900	716,522.00	0.12
358	601718	际华集团	230,900	715,790.00	0.12
359	600398	海澜之家	150,300	713,925.00	0.12
360	600507	方大特钢	102,110	713,748.90	0.12
361	000540	中天金融	368,300	710,819.00	0.12
362	300072	三聚环保	140,200	709,412.00	0.12
363	300888	稳健医疗	10,600	704,900.00	0.12
364	600737	中粮糖业	93,500	703,120.00	0.12
365	600582	天地科技	144,845	692,359.10	0.11
366	000937	冀中能源	92,700	691,542.00	0.11
367	002010	传化智联	107,500	691,225.00	0.11
368	000089	深圳机场	89,400	690,168.00	0.11
369	000559	万向钱潮	115,900	688,446.00	0.11
370	002048	宁波华翔	42,572	682,003.44	0.11
371	002368	太极股份	35,397	679,976.37	0.11
372	600967	内蒙一机	74,400	678,528.00	0.11
373	603883	老百姓	19,994	677,396.72	0.11

374	000898	鞍钢股份	209,900	675,878.00	0.11
375	600435	北方导航	78,072	672,980.64	0.11
376	601000	唐山港	259,698	670,020.84	0.11
377	600871	石化油服	351,500	664,335.00	0.11
378	002690	美亚光电	30,590	663,191.20	0.11
379	001914	招商积余	36,800	661,296.00	0.11
380	002110	三钢闽光	107,400	654,066.00	0.11
381	600195	中牧股份	53,271	653,102.46	0.11
382	601568	北元集团	102,400	649,216.00	0.11
383	601333	广深铁路	297,100	647,678.00	0.11
384	002233	塔牌集团	72,852	644,740.20	0.11
385	002281	光迅科技	36,560	642,724.80	0.11
386	600556	天下秀	78,000	641,940.00	0.11
387	000156	华数传媒	80,000	637,600.00	0.10
388	600811	东方集团	224,440	635,165.20	0.10
389	000959	首钢股份	133,200	634,032.00	0.10
390	002705	新宝股份	28,800	633,312.00	0.10
391	000537	广宇发展	48,700	632,613.00	0.10
392	600764	中国海防	24,800	625,952.00	0.10
393	003035	南网能源	98,500	625,475.00	0.10
394	002174	游族网络	63,900	624,303.00	0.10
395	000402	金融街	104,500	621,775.00	0.10
396	688321	微芯生物	24,579	619,145.01	0.10
397	600329	达仁堂	25,062	616,023.96	0.10
398	600120	浙江东方	152,090	609,880.90	0.10
399	600126	杭钢股份	118,200	605,184.00	0.10
400	300212	易华录	34,720	604,128.00	0.10
401	000488	晨鸣纸业	107,059	603,812.76	0.10
402	002416	爱施德	64,900	603,570.00	0.10
403	603638	艾迪精密	29,320	601,060.00	0.10
404	601200	上海环境	58,920	598,627.20	0.10
405	600167	联美控股	79,880	598,301.20	0.10
406	600446	金证股份	57,500	596,850.00	0.10
407	000990	诚志股份	54,500	596,775.00	0.10
408	000685	中山公用	77,274	593,464.32	0.10
409	002081	金螳螂	116,800	593,344.00	0.10
410	601098	中南传媒	62,700	591,888.00	0.10
411	600373	中文传媒	59,100	590,409.00	0.10
412	002867	周大生	37,950	589,363.50	0.10
413	600707	彩虹股份	125,700	588,276.00	0.10
414	000158	常山北明	97,900	587,400.00	0.10
415	002382	蓝帆医疗	61,300	585,415.00	0.10

416	002925	盈趣科技	27,040	581,900.80	0.10
417	601611	中国核建	69,300	581,427.00	0.10
418	601608	中信重工	152,200	576,838.00	0.09
419	002146	荣盛发展	190,300	576,609.00	0.09
420	001965	招商公路	75,500	576,065.00	0.09
421	600095	湘财股份	74,100	569,829.00	0.09
422	002399	海普瑞	32,300	567,834.00	0.09
423	600131	国网信通	41,700	560,865.00	0.09
424	603317	天味食品	19,680	560,289.60	0.09
425	000967	盈峰环境	110,700	560,142.00	0.09
426	688088	虹软科技	17,689	558,795.51	0.09
427	000528	柳工	85,380	555,823.80	0.09
428	600376	首开股份	112,800	553,848.00	0.09
429	002387	维信诺	82,300	553,056.00	0.09
430	002948	青岛银行	152,630	552,520.60	0.09
431	600623	华谊集团	65,500	543,650.00	0.09
432	000563	陕国投 A	173,532	541,419.84	0.09
433	603000	人民网	48,100	538,720.00	0.09
434	601187	厦门银行	90,200	537,592.00	0.09
435	002423	中粮资本	80,100	537,471.00	0.09
436	600901	江苏租赁	104,400	535,572.00	0.09
437	601598	中国外运	137,900	535,052.00	0.09
438	600307	酒钢宏兴	274,500	532,530.00	0.09
439	600006	东风汽车	70,043	528,824.65	0.09
440	601991	大唐发电	217,300	528,039.00	0.09
441	300257	开山股份	34,700	519,112.00	0.09
442	603228	景旺电子	22,088	515,313.04	0.08
443	000961	中南建设	167,500	510,875.00	0.08
444	600906	财达证券	56,600	508,834.00	0.08
445	600717	天津港	126,538	507,417.38	0.08
446	603650	彤程新材	15,500	504,990.00	0.08
447	002434	万里扬	57,500	491,625.00	0.08
448	000718	苏宁环球	132,800	488,704.00	0.08
449	002242	九阳股份	26,541	487,292.76	0.08
450	000671	阳光城	217,500	476,325.00	0.08
451	601928	凤凰传媒	66,500	475,475.00	0.08
452	000415	渤海租赁	216,700	470,239.00	0.08
453	600968	海油发展	178,100	459,498.00	0.08
454	000553	安道麦 A	37,900	458,969.00	0.08
455	601969	海南矿业	52,800	453,552.00	0.07
456	000031	大悦城	112,383	449,532.00	0.07
457	600648	外高桥	32,300	439,280.00	0.07

458	600787	中储股份	76,534	435,478.46	0.07
459	600928	西安银行	116,600	427,922.00	0.07
460	600339	中油工程	146,700	423,963.00	0.07
461	002563	森马服饰	70,500	417,360.00	0.07
462	601228	广州港	108,400	397,828.00	0.07
463	002815	崇达技术	30,400	389,424.00	0.06
464	600835	上海机电	28,146	386,444.58	0.06
465	000028	国药一致	12,657	377,052.03	0.06
466	000717	韶钢松山	105,900	370,650.00	0.06
467	600377	宁沪高速	43,100	369,367.00	0.06
468	688819	天能股份	10,426	360,531.08	0.06
469	300869	康泰医学	12,700	358,902.00	0.06
470	603056	德邦股份	26,700	358,581.00	0.06
471	002945	华林证券	23,400	356,850.00	0.06
472	603379	三美股份	15,800	351,550.00	0.06
473	601139	深圳燃气	50,200	348,388.00	0.06
474	000869	张裕 A	11,600	344,984.00	0.06
475	000062	深圳华强	27,160	344,932.00	0.06
476	600299	安迪苏	35,000	335,300.00	0.06
477	601298	青岛港	61,000	333,670.00	0.05
478	601869	长飞光纤	10,300	318,476.00	0.05
479	603868	飞科电器	4,000	303,000.00	0.05
480	001872	招商港口	19,400	302,640.00	0.05
481	601156	东航物流	15,100	298,980.00	0.05
482	002653	海思科	18,400	296,424.00	0.05
483	300741	华宝股份	10,600	294,892.00	0.05
484	600823	世茂股份	98,300	292,934.00	0.05
485	600350	山东高速	54,400	285,600.00	0.05
486	601828	美凯龙	45,500	275,730.00	0.05
487	600927	永安期货	13,300	268,261.00	0.04
488	001227	兰州银行	52,700	259,284.00	0.04
489	603355	莱克电气	9,780	246,749.40	0.04
490	603786	科博达	3,700	227,809.00	0.04
491	603515	欧普照明	12,800	223,360.00	0.04
492	001203	大中矿业	19,600	221,480.00	0.04
493	601665	齐鲁银行	43,700	213,256.00	0.04
494	603719	良品铺子	6,900	197,547.00	0.03
495	002946	新乳业	14,900	193,551.00	0.03
496	601003	柳钢股份	44,600	180,630.00	0.03
497	600956	新天绿能	12,200	150,304.00	0.02
498	002901	大博医疗	3,800	148,732.00	0.02
499	603983	丸美股份	4,400	117,920.00	0.02

500	600917	重庆燃气	15,100	109,022.00	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	301302	华如科技	4,598	279,778.12	0.05
2	301175	中科环保	60,403	230,739.46	0.04
3	688400	凌云光	9,358	205,220.94	0.03
4	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.03
5	301220	亚香股份	2,849	121,230.27	0.02
6	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.02
7	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
8	301238	瑞泰新材	1,547	49,612.29	0.01
9	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
10	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
11	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
12	301217	铜冠铜箔	1,337	19,827.71	0.00
13	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
14	301207	华兰疫苗	322	18,167.24	0.00
15	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
16	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
17	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
18	301206	三元生物	354	16,174.26	0.00
19	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
20	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
21	301151	冠龙节能	698	14,979.08	0.00
22	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
23	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
24	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
25	301200	大族数控	240	12,460.80	0.00
26	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
27	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
28	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
29	301219	腾远钴业	122	10,714.04	0.00
30	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
31	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
32	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
33	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
34	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
35	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
36	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
37	301110	青木股份	180	7,173.00	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	600522	中天科技	3,648,407.02	0.68
2	002340	格林美	3,296,577.00	0.61
3	000733	振华科技	3,268,295.31	0.61
4	600157	永泰能源	3,140,707.00	0.58
5	002497	雅化集团	3,079,837.00	0.57
6	002240	盛新锂能	3,010,600.00	0.56
7	601615	明阳智能	2,971,250.00	0.55
8	600256	广汇能源	2,885,043.00	0.53
9	002180	纳思达	2,879,162.91	0.53
10	000723	美锦能源	2,797,870.00	0.52
11	689009	九号公司-WD	2,734,165.37	0.51
12	601555	东吴证券	2,730,708.88	0.51
13	000009	中国宝安	2,640,231.00	0.49
14	688099	晶晨股份	2,615,761.40	0.48
15	600885	宏发股份	2,606,720.00	0.48
16	601117	中国化学	2,592,118.68	0.48
17	300390	天华超净	2,583,964.00	0.48
18	002407	多氟多	2,556,974.00	0.47
19	688180	君实生物-U	2,487,970.91	0.46
20	688005	容百科技	2,434,294.84	0.45

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	6,049,548.43	1.12
2	002340	格林美	5,762,986.75	1.07
3	600188	兖矿能源	4,803,969.54	0.89
4	000723	美锦能源	4,667,437.72	0.86
5	601117	中国化学	4,410,058.26	0.82
6	688005	容百科技	4,166,303.97	0.77
7	600884	杉杉股份	3,869,020.73	0.72
8	300751	迈为股份	3,861,073.00	0.72
9	605358	立昂微	3,722,169.40	0.69
10	002013	中航机电	3,557,679.50	0.66
11	600754	锦江酒店	3,531,433.50	0.65
12	601689	拓普集团	3,427,493.00	0.63
13	300763	锦浪科技	3,104,911.00	0.58

14	600522	中天科技	2,713,530.11	0.50
15	600733	北汽蓝谷	2,571,709.00	0.48
16	300223	北京君正	2,542,040.00	0.47
17	002080	中材科技	2,419,772.00	0.45
18	600157	永泰能源	2,374,282.00	0.44
19	600803	新奥股份	2,290,022.00	0.42
20	603290	斯达半导	2,223,570.00	0.41

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	578,898,401.68
卖出股票收入（成交）总额	455,068,675.17

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 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	206,083.21
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,704,494.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,910,578.07

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	207,662.84	0.03	新股未上市
1	301175	中科环保	23,076.62	0.00	新股流通受限
2	688400	凌云光	205,220.94	0.03	新股流通受限
3	301239	普瑞眼科	174,037.80	0.03	新股未上市
3	301239	普瑞眼科	19,348.75	0.00	新股流通受限
4	301302	华如科技	25,953.20	0.00	新股流通受限
5	301220	亚香股份	11,157.75	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

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)	42,575	7,354.77	108,082,891.25	34.52	205,046,328.76	65.48
鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)	1,970	16,449.65	4,034,869.46	12.45	28,370,947.97	87.55
合计	44,545	7,756.99	112,117,760.71	32.45	233,417,276.73	67.55

8.2 期末上市基金前十名持有人

鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	赵建伟	428,372.00	6.97
2	张宏旭	200,012.00	3.25
3	施红梅	196,914.00	3.20
4	陈吉荃	150,042.00	2.44
5	张宇	133,500.00	2.17
6	鹿敏理	119,003.00	1.94
7	俞富良	117,026.00	1.90
8	于兆瑞	106,303.00	1.73
9	赵丽丽	100,017.00	1.63
10	余广述	100,015.00	1.63

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	22,454.68	0.0072
	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)	143,254.94	0.4421

有本基金			
	合计	165,709.62	0.0480

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)
基金合同生效日 (2010 年 2 月 5 日) 基金份额总额	2,630,723,634.12	-
本报告期期初基金份额总额	192,963,543.71	79,395,514.35
本报告期基金总申购份额	152,933,238.62	216,482,174.05
减：本报告期基金总赎回份额	32,767,562.32	263,471,870.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	313,129,220.01	32,405,817.43

§ 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

本报告期内本基金管理人、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 (%)	
长江证券	1	497,455,481.90	48.55	454,699.24	48.09	-
银河证券	1	455,027,563.18	44.41	423,782.37	44.82	-
国信证券	2	72,067,771.01	7.03	67,088.15	7.09	-
广发证券	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

金额单位：人民币元

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于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	2022 年 01 月 17 日
4	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行 E 通平台申购（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	2022 年 01 月 19 日
5	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 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
6	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	2022 年 01 月 21 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与民生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	2022 年 01 月 24 日

	公告		
8	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	2022 年 02 月 09 日
9	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	2022 年 02 月 09 日
10	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	2022 年 02 月 09 日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与第一创业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	2022 年 02 月 10 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京雪球基金销售有限公司申购 (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	2022 年 02 月 21 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与财通证券股份有限公司申购 (含定期定额申购) 费率优惠活动的公告	《中国证券报》、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 01 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中信建投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	2022 年 03 月 08 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与光大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	2022 年 03 月 14 日
16	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易管家平台申购 (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	2022 年 03 月 15 日
17	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国光大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	2022 年 03 月 22 日
18	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 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
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与广发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	2022 年 04 月 19 日

	公告		
20	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 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
21	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易管家平台申购 (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	2022 年 04 月 21 日
22	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	2022 年 04 月 25 日
23	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	2022 年 04 月 27 日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与江苏张家港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	2022 年 04 月 28 日
25	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	2022 年 04 月 30 日
26	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
27	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
28	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
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海好买基金销售有限公司申购 (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	2022 年 06 月 06 日
30	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中航证券有限公司申购 (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	2022 年 06 月 18 日

注：无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类	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	20220121~202206	38,588,332.55	120,706,965.65	159,295,298.20	0.00	0.00
	2	20220304~20220630	0.00	107,272,958.74	0.00	107,272,958.74	31.05
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 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) 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。

2022 年 8 月 30 日