

鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金  
(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：招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。

基金托管人招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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
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
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	12
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
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
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51

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 .....	51
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 .....	51
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 .....	52
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 .....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
7.12 投资组合报告附注 .....	52
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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 .....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	58
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</b>
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 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录 .....	61
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金 (LOF)	
基金简称	鹏华中证一带一路主题指数 (LOF)	
场内简称	带路 LOF	
基金主代码	160638	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 18 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	220,679,678.53 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	2021 年 1 月 18 日	
下属分级基金的基 金简称	鹏华中证一带一路主题指数 (LOF) A	鹏华中证一带一路主题指数 (LOF) C
下属分级基金的场 内简称	带路 LOF	-
下属分级基金的交 易代码	160638	015677
报告期末下属分级 基金的份额总额	220,332,709.22 份	346,969.31 份

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。
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。本基金力争基金份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。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。
业绩比较基准	中证一带一路主题指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	张燕
	联系电话	0755-81395402	0755-83199084
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006788999	95555
传真		0755-82021126	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		何如	缪建民

### 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	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
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)	2022年05月20日(基金合同生效日)-2022年06月30日
	鹏华中证一带一路主题指数(LOF)A	鹏华中证一带一路主题指数(LOF)C
本期已实现收益	4,775,833.78	3,140.11
本期利润	-18,554,623.40	11,835.47
加权平均基金份额本期利润	-0.0871	0.0866
本期加权平均净值利润率	-5.20%	8.30%
本期基金份额净值增长率	-5.17%	6.60%
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	-235,099,543.73	4,295.82
期末可供分配基金份额利润	-1.0670	0.0124
期末基金资产净值	379,557,308.92	369,853.34
期末基金份额净值	1.723	1.066
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	-19.63%	6.60%

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

鹏华中证一带一路主题指数(LOF)A

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	4.68%	0.77%	3.32%	0.76%	1.36%	0.01%
过去三个月	6.16%	1.41%	4.55%	1.41%	1.61%	0.00%
过去六个月	-5.17%	1.47%	-6.48%	1.47%	1.31%	0.00%
过去一年	10.17%	1.33%	6.48%	1.33%	3.69%	0.00%
过去三年	60.35%	1.28%	32.16%	1.28%	28.19%	0.00%
自基金合同生效起至今	-19.63%	1.60%	-25.58%	1.58%	5.95%	0.02%

鹏华中证一带一路主题指数(LOF)C

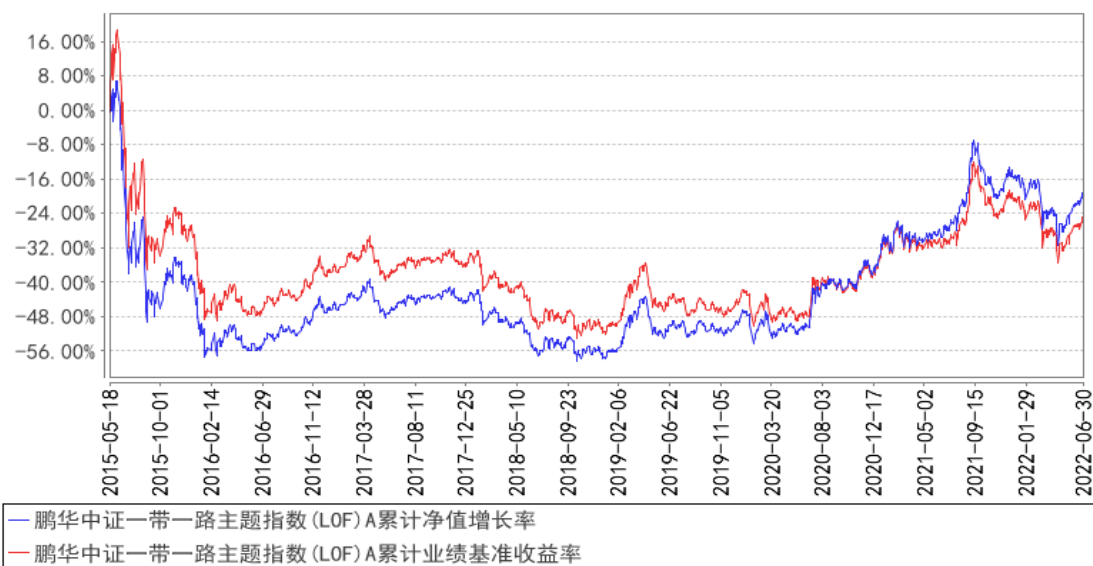
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.61%	0.78%	3.32%	0.76%	1.29%	0.02%
自基金合同生效起至今	6.60%	0.94%	6.89%	0.96%	-0.29%	-0.02%

注：业绩比较基准=中证一带一路主题指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%

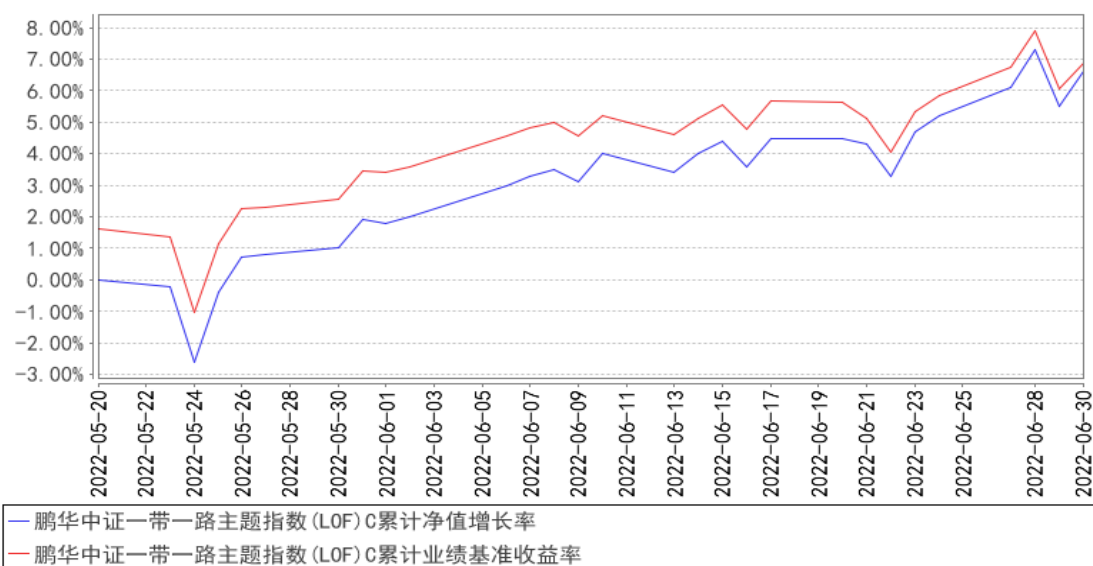


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鹏华中证一带一路主题指数(LOF)A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



鹏华中证一带一路主题指数(LOF)C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 2015 年 05 月 18 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		
罗英宇	基金经理	2021-01-20	-	15 年	罗英宇先生，国籍中国，管理学硕士，15 年证券从业经验。曾任招商银行股份有限公司高级程序员，博时基金管理有限公司信息技术部高级程序员。2008 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任信息技术部系统分析员、总经理助理、副总经理、量化及衍生品投资部金融科技副总监，现担任量化及衍生品投资部基金经理。2020 年 12 月至 2022 年 01 月担任鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2020 年 12 月至 2022 年 03 月担任鹏华中证高股息龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 12 月至今担任鹏华国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 01 月至今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 月至今担任鹏华中证信息技术指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2021 年 01 月至今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移动互联网指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2021 年 01 月至今担任鹏华中证高铁产业指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理，2021 年 08 月至今担任鹏华国证半导体芯片交易型开放式指数证券

					<p>投资基金联接基金基金经理, 2021 年 09 月至今担任鹏华国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2021 年 11 月至今担任鹏华中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今担任鹏华中证工业互联网主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 罗英宇先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。</p>
--	--	--	--	--	--

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

报告期内，本产品采用完全复制的方法跟踪中证一带一路主题指数，努力将跟踪误差控制在合理范围。在此基础上，认真应对投资者日常申购、赎回和成份股调整等工作，并通过遵从严格的风险、合规管理流程，确保了本基金的安全运作。

#### 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-5.17%，同期业绩比较基准增长率为-6.48%，C 类份额净值增长率为 6.60%，同期业绩比较基准增长率为 6.89%。

#### 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 年上半年市场整体下行，上证指数累计下跌 6.63%，深证成指下跌 13.20%，创业板指下跌 15.41%。受海外流动性超预期收紧、俄乌冲突加剧通胀风险、国内疫情扰动等多重因素影响，全球风险资产宽幅震荡，二季度经济数据二次探底预期下，市场风险偏好情绪降至冰点。4 月底召开的政治局会议对国内经济形势释放出积极的政策信号，维护了资本市场的平稳运行，5 月份在消化了前期不利因素后，政策加码的必要性和紧迫性都在提升，市场开启修复行情，其中新能源产业链相关股持续上攻，带动 A 股三大股指走出独立行情，上半年的反弹程度均达两位数，尤其是创业板指的最大反弹达 34.93%。

展望下半年，海外来看，市场开始交易衰退。美国 PMI 指数由前月的 56.1 下行至 53，多数西方国家同样延续下行趋势，显示出经济衰退可能渐行渐近。预计四季度主要欧洲国家 PMI 可能降至荣枯线以下，经济衰退可能早于美国。国内维度上，政策宽松环境对资本市场“频送暖风”，海外流动性冲击对国内市场的影响将渐渐弱化，A 股节奏将更加凸显“以我为主”的特征。应择优布局鼓励发展的产业中的重点企业，比如在能源革命、新兴消费、数字经济等领域中的优质企业。行业配置方面从周期转向消费与科技，重点关注硬科技、扩大内需战略下的大消费、双碳产业链、新老基建等行业。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金鹏华中证一带一路主题指数 (LOF)A 期末可供分配利润为 -235,099,543.73 元，期末基金份额净值 1.723 元，不符合利润分配条件；鹏华中证一带一路主题指数 (LOF)C 期末可供分配利润为 4,295.82 元，期末基金份额净值 1.066 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

托管人声明：招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

#### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金 (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
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	21,998,211.84	19,526,315.96
结算备付金		188,037.78	9,995.84
存出保证金		18,824.28	27,086.27
交易性金融资产	6.4.7.2	359,564,907.50	333,926,331.84
其中: 股票投资		359,564,907.50	333,926,331.84
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		-	362,187.92
应收股利		-	-
应收申购款		216,608.36	261,864.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	2,111.37
资产总计		381,986,589.76	354,115,893.35
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
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		573,267.14	-
应付赎回款		876,080.79	623,580.25
应付管理人报酬		315,519.19	299,637.64
应付托管费		69,414.25	65,920.28
应付销售服务费		43.34	-
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	225,102.79	301,517.66
负债合计		2,059,427.50	1,290,655.83
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	472,629,222.21	416,110,608.16
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-92,702,059.95	-63,285,370.64
净资产合计		379,927,162.26	352,825,237.52
负债和净资产总计		381,986,589.76	354,115,893.35

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额为 220,679,678.53 份，其中鹏华中证一带一路主题指数 (LOF)A 基金份额总额为 220,332,709.22 份，基金份额净值 1.723 元；鹏华中证一带一路主题指数 (LOF)C 基金份额总额为 346,969.31 份，基金份额净值 1.066 元。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金 (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	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
<b>一、营业总收入</b>		-16,207,445.45	39,013,887.71
1. 利息收入		38,409.75	31,024.68
其中：存款利息收入	6.4.7.13	38,409.75	31,024.68
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）		6,993,238.74	29,118,390.68
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,380,372.70	26,141,190.73
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	5,612,866.04	2,977,199.95
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	-23,321,761.82	9,763,429.56
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	82,667.88	101,042.79
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2,335,342.48</b>	<b>2,319,256.20</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,763,590.58	1,527,545.33
2. 托管费	6.4.10.2.2	387,989.99	336,059.97
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	46.52	-
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	183,715.39	455,650.90
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-18,542,787.93</b>	<b>36,694,631.51</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-18,542,787.93</b>	<b>36,694,631.51</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-18,542,787.93</b>	<b>36,694,631.51</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(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)	416,110,608.16	-	-63,285,370.64	352,825,237.52
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 )	416,110,608.16	-	-63,285,370.64	352,825,237.52
三、本 期 增 减 变 动 额 ( 减 少 以 “- ” 号 填 列 )	56,518,614.05	-	-29,416,689.31	27,101,924.74
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	-18,542,787.93	-18,542,787.93
(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 )	56,518,614.05	-	-10,873,901.38	45,644,712.67
其中:1. 基 金 申 购 款	135,311,415.64	-	-27,243,267.05	108,068,148.59
2 .基 金 赎 回 款	-78,792,801.59	-	16,369,365.67	-62,423,435.92
(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)	472,629,222.21	-	-92,702,059.95	379,927,162.26
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)	486,843,798.36	-	-170,938,764.90	315,905,033.46
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)	486,843,798.36	-	-170,938,764.90	315,905,033.46
三、本期 增减变 动额(减 少以“-” 号填列)	-78,037,896.29	-	60,336,659.48	-17,701,236.81
(一)、 综合收 益总额	-	-	36,694,631.51	36,694,631.51
(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)	-78,037,896.29	-	23,642,027.97	-54,395,868.32

其中:1. 基金申购款	64,178,920.51	-	-18,747,657.06	45,431,263.45
2. 基金赎回款	-142,216,816.80	-	42,389,685.03	-99,827,131.77
(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)	408,805,902.07	-	-110,602,105.42	298,203,796.65

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

基金管理人负责人

邢彪

主管会计工作负责人

郝文高

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金 (LOF) (原鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金, 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 [2015] 第 769 号《关于准予鹏华中证一带一路主题指数分级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《鹏华中证一带一路主题指数

分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，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 606,374,145.94 元，业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(2015)第 484 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 606,402,064.93 份基金份额，其中认购资金利息折合 27,918.99 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》并报中国证监会备案，本基金的基金份额包括鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“鹏华一带一路份额”)、鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金之 A 份额(以下简称“鹏华带路 A 份额”)、鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金之 B 份额(以下简称“鹏华带路 B 份额”)。根据对基金财产及收益分配的不同安排，本基金的基金份额具有不同的风险收益特征。鹏华一带一路份额为可以申购、赎回但不能上市交易的基金份额，具有与标的指数相似的风险收益特征。鹏华带路 A 份额与鹏华带路 B 份额为可以上市交易但不能申购、赎回的基金份额，其中鹏华带路 A 份额为稳健收益类份额，具有低风险且预期收益相对较低的风险收益特征，鹏华带路 B 份额为积极收益类份额，具有高风险且预期收益相对较高的风险收益特征。鹏华带路 A 份额与鹏华带路 B 份额的配比始终保持 1:1 的比率不变。本基金的基金份额初始公开发售结束后，场外认购的全部份额将确认为鹏华一带一路份额；场内认购的份额将按照 1:1 的比例确认为鹏华带路 A 份额与鹏华带路 B 份额。本基金基金合同生效后，鹏华一带一路份额与鹏华带路 A 份额、鹏华带路 B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。基金份额的分拆，指基金份额持有人将其持有的鹏华一带一路份额按照 2 份场内鹏华一带一路份额对应 1 份鹏华带路 A 份额与 1 份鹏华带路 B 份额的比例进行转换的行为；基金份额的合并，指基金份额持有人将其持有的鹏华带路 A 份额与鹏华带路 B 份额按照 1 份鹏华带路 A 份额与 1 份鹏华带路 B 份额对应 2 份场内鹏华一带一路份额的比例进行转换的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：鹏华一带一路份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为鹏华一带一路份额、鹏华带路 A 份额、鹏华带路 B 份额的份额数之和。鹏华带路 A 份额的基金份额净值为鹏华带路 A 份额的本金及约定应得收益之和。每 2 份鹏华一带一路份额所对应的基金资产净值等于 1 份鹏华带路 A 份额与 1 份鹏华带路 B 份额所对应的基金资产净值之和。

本基金定期进行份额折算。在鹏华带路 A 份额、鹏华一带一路份额存续期内的每个会计年度 9 月第一个工作日，本基金将进行基金的定期份额折算。在基金份额折算前与折算后，鹏华带路 A

份额与鹏华带路 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于鹏华带路 A 份额的约定应得收益,即鹏华带路 A 份额每个会计年度 8 月 31 日基金份额参考净值超出 1.000 元部分,将折算为场内鹏华一带一路份额分配给鹏华带路 A 份额持有人。鹏华一带一路份额持有人持有的每 2 份鹏华一带一路份额将按 1 份鹏华带路 A 份额获得新增鹏华一带一路份额的分配。持有场外鹏华一带一路份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外鹏华一带一路份额的分配;持有场内鹏华一带一路份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内鹏华一带一路份额的分配。经过上述份额折算,鹏华带路 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元,鹏华一带一路份额的基金份额净值将相应调整。

除定期份额折算外,本基金还将在鹏华一带一路份额的基金份额净值达到 1.500 元时或鹏华带路 B 份额的基金份额参考净值跌至 0.250 元时进行不定期份额折算。当达到不定期折算条件时,本基金将分别对鹏华一带一路份额、鹏华带路 A 份额、鹏华带路 B 份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保鹏华带路 A 份额与鹏华带路 B 份额的比例为 1:1,份额折算后鹏华一带一路份额的基金份额净值、鹏华带路 A 份额与鹏华带路 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2015]第 213 号文审核同意,本基金鹏华带路 A 份额 146,134,555.00 份基金份额和鹏华带路 B 份额 146,134,555.00 份基金份额于 2015 年 5 月 25 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的鹏华一带一路份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其分拆为鹏华带路 A 份额和鹏华带路 B 份额即可上市流通;对于托管在场外的鹏华一带一路份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其跨系统转托管至深交所场内后分拆为鹏华带路 A 份额和鹏华带路 B 份额即可上市流通。

本基金管理人鹏华基金管理有限公司向深交所申请鹏华带路 A 份额和鹏华带路 B 份额终止上市并于 2020 年 11 月 20 日获得同意(《终止上市通知书》深证上[2020]1091 号)。本基金管理人于 2020 年 12 月 2 日发布《关于鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金之鹏华带路 A 份额和鹏华带路 B 份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》,在 2020 年 12 月 31 日(份额折算基准日)日终,以鹏华一带一路份额的基金份额净值为基准,鹏华带路 A 份额、鹏华带路 B 份额按照各自的基金份额净值折算成鹏华一带一路份额的场内份额。

根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等相关规定,经基金管理人与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,鹏华带路 A 份额和鹏华带路 B 份额终止运作后,于鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金折算基准日次日(2021 年 1 月 1 日)《鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》生效,《鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

经深交所深证上[2021]42号文审核同意，本基金14,612,131.00份基金份额于2021年1月18日在深交所挂牌交易。未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

根据鹏华基金管理有限公司《关于鹏华基金管理有限公司旗下三只基金新增C类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》，本基金根据申购费、赎回费及销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，自2022年5月20日起新增C类基金份额并单独设置基金代码，原有的基金份额转为A类基金份额。其中，在投资人申购时收取申购费用，并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；在投资人申购时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。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《鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股(含中小板、创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票)、债券、股指期货、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。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。本基金投资于股票部分的比例不低于基金资产的80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：中证一带一路主题指数收益率 $\times$ 95%+商业银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 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》、《鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(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、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2,093.00元、4.95元、13.42元、-2,111.37元、-84,461.79元和84,461.79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	21,998,211.84
等于：本金	21,995,952.69
加：应计利息	2,259.15
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	21,998,211.84

## 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	347,996,162.29	-	359,564,907.50	11,568,745.21
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	347,996,162.29	-	359,564,907.50	11,568,745.21

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	2,558.86
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	90,721.07
其中：交易所市场	90,721.07
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	81,822.86
应付指数使用费	50,000.00
合计	225,102.79

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华中证一带一路主题指数(LOF)A

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	194,130,795.81	416,110,608.16
本期申购	62,884,595.88	134,807,797.16
本期赎回(以“-”号填列)	-36,682,682.47	-78,636,152.42

-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	220,332,709.22	472,282,252.90

## 鹏华中证一带一路主题指数(LOF)C

项目	本期 2022年5月20日(基金合同生效日)至2022年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	503,618.48	503,618.48
本期赎回(以“-”号填列)	-156,649.17	-156,649.17
-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	346,969.31	346,969.31

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

## 鹏华中证一带一路主题指数(LOF)A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-211,301,629.09	148,016,258.45	-63,285,370.64
本期利润	4,775,833.78	-23,330,457.18	-18,554,623.40
本期基金份额交易产生的变动数	-28,573,748.42	17,688,798.48	-10,884,949.94
其中：基金申购款	-68,320,065.03	41,059,031.88	-27,261,033.15
基金赎回款	39,746,316.61	-23,370,233.40	16,376,083.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-235,099,543.73	142,374,599.75	-92,724,943.98

## 鹏华中证一带一路主题指数(LOF)C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	3,140.11	8,695.36	11,835.47
本期基金份额交易产生的变动数	1,155.71	9,892.85	11,048.56
其中：基金申购款	1,901.72	15,864.38	17,766.10
基金赎回款	-746.01	-5,971.53	-6,717.54
本期已分配利润	-	-	-

本期末	4,295.82	18,588.21	22,884.03
-----	----------	-----------	-----------

#### 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		34,360.87
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		1,161.57
其他		2,887.31
合计		38,409.75

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		1,380,372.70
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		1,380,372.70

##### 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		70,287,226.54
减：卖出股票成本总额		68,645,685.74
减：交易费用		261,168.10
买卖股票差价收入		1,380,372.70

##### 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	5,612,866.04
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	5,612,866.04

#### 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	-23,321,761.82
股票投资	-23,321,761.82
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	-23,321,761.82

#### 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	78,196.05
基金转换费收入	4,471.83
合计	82,667.88

#### 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	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1,892.53
指数使用费	100,000.00
合计	183,715.39

#### 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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	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	-	-	2,181,046.93	1.65

###### 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	-	-	-	-
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	1,769.64	1.49	576.65	0.95

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	1,763,590.58	1,527,545.33
其中：支付销售机构的客户维护费	569,212.43	684,746.28

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1.00%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.00%÷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	387,989.99	336,059.97
----------------	------------	------------

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22%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×0.22%/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		
	鹏华中证一带一路主题 指数(LOF)A	鹏华中证一带一路主题 指数(LOF)C	合计
鹏华基金公司	-	7.44	7.44
合计	-	7.44	7.44
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		
	鹏华中证一带一路主题 指数(LOF)A	鹏华中证一带一路主题 指数(LOF)C	合计
鹏华基金公司	-	-	-
合计	-	-	-

注：鹏华中证一带一路主题指数(LOF)A 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一带一路主题指数(LOF)C 基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，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×0.30%÷当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

## 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
招商银行	21,998,211.84	34,360.87	16,908,488.75	30,485.75

## 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

## 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	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位:股)				
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	221	10,342.80	12,031.24	-	
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	-	
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	-	
301136	招标股份	2021年12月31日	6个月	新股流通受限	10.52	19.74	7,172	75,449.44	141,575.28	-	
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	-	
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	36,973	141,236.86	141,236.86	-	
301175	中科环保	2022年6月30日	6个月	新股流通受限	3.82	3.82	4,109	15,696.38	15,696.38	-	
301187	欧圣电气	2022年4月13日	6个月	新股流通受限	21.33	22.54	713	15,208.29	16,071.02	-	
301206	三元生物	2022年1月26日	6个月	新股流通受限	109.30	45.69	245	17,815.90	11,194.05	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	209	11,887.92	11,791.78	-	

301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	新股流通受限	17.27	14.83	908	15,681.16	13,465.64	-
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	-
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	-
688048	长光华芯	2022年3月25日	6个月	新股流通受限	80.80	111.97	2,007	162,165.60	224,723.79	-
688171	纬德信息	2022年1月20日	6个月	新股流通受限	28.68	22.77	2,821	80,906.28	64,234.17	-
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	1,512	63,352.80	48,232.80	-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	6,329	138,794.97	138,794.97	-

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

注：无。

#### 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

本基金为指数型基金。本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股(含中小板，创业板股票及其他中国证监会核准上市的股票)，债券，股指期货，权证，资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。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招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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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



持续的监测和分析。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。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	21,998,211.84	-	-	-	21,998,211.84
结算备付金	188,037.78	-	-	-	188,037.78
存出保证金	18,824.28	-	-	-	18,824.28
交易性金融资产	-	-	-	359,564,907.50	359,564,907.50
应收申购款	-	-	-	216,608.36	216,608.36

资产总计	22,205,073.90	-	-	-359,781,515.86	381,986,589.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	876,080.79	876,080.79
应付管理人报酬	-	-	-	315,519.19	315,519.19
应付托管费	-	-	-	69,414.25	69,414.25
应付清算款	-	-	-	573,267.14	573,267.14
应付销售服务费	-	-	-	43.34	43.34
其他负债	-	-	-	225,102.79	225,102.79
负债总计	-	-	-	2,059,427.50	2,059,427.50
利率敏感度缺口	22,205,073.90	-	-	-357,722,088.36	379,927,162.26
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	19,526,315.96	-	-	-	19,526,315.96
结算备付金	9,995.84	-	-	-	9,995.84
存出保证金	27,086.27	-	-	-	27,086.27
交易性金融资产	-	-	-	-333,926,331.84	333,926,331.84
应收申购款	-	-	-	261,864.15	261,864.15
应收清算款	-	-	-	362,187.92	362,187.92
其他资产	-	-	-	2,111.37	2,111.37
资产总计	19,563,398.07	-	-	-334,552,495.28	354,115,893.35
负债					
应付赎回款	-	-	-	623,580.25	623,580.25
应付管理人报酬	-	-	-	299,637.64	299,637.64
应付托管费	-	-	-	65,920.28	65,920.28
其他负债	-	-	-	301,517.66	301,517.66
负债总计	-	-	-	1,290,655.83	1,290,655.83
利率敏感度缺口	19,563,398.07	-	-	-333,261,839.45	352,825,237.52

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：投资于股票部分的比例不低于基金资产的80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。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	359,564,907.50	94.64	333,926,331.84	94.64
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	359,564,907.50	94.64	333,926,331.84	94.64

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%	17,978,153.32	16,660,407.72
	业绩比较基准下降5%	-17,978,153.32	-16,660,407.72

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	358,471,148.24
第二层次	480,475.30
第三层次	613,283.96
合计	359,564,907.50

#### 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	359,564,907.50	94.13
	其中：股票	359,564,907.50	94.13
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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	22,186,249.62	5.81
8	其他各项资产	235,432.64	0.06
9	合计	381,986,589.76	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	35,151,618.40	9.25
C	制造业	201,503,120.72	53.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,756,017.00	2.04
E	建筑业	55,921,208.54	14.72
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	33,218,549.55	8.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,821,223.00	2.59
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	13,486,647.00	3.55
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,464,734.10	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	358,323,118.31	94.31

### 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	759,552.44	0.20
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	163,230.61	0.04
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	149,162.10	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	169,844.04	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,241,789.19	0.33

### 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	601888	中国中免	57,900	13,486,647.00	3.55
2	600089	特变电工	450,939	12,351,219.21	3.25
3	600309	万华化学	126,300	12,249,837.00	3.22
4	600031	三一重工	618,945	11,797,091.70	3.11
5	000063	中兴通讯	423,900	10,822,167.00	2.85
6	601668	中国建筑	1,973,780	10,500,509.60	2.76
7	600585	海螺水泥	297,600	10,499,328.00	2.76
8	688599	天合光能	154,377	10,073,099.25	2.65
9	600406	国电南瑞	363,749	9,821,223.00	2.59
10	000338	潍柴动力	772,700	9,635,569.00	2.54
11	601899	紫金矿业	1,027,200	9,583,776.00	2.52
12	601919	中远海控	678,620	9,432,818.00	2.48

13	601766	中国中车	1,732,150	9,007,180.00	2.37
14	600522	中天科技	388,750	8,980,125.00	2.36
15	601390	中国中铁	1,461,968	8,976,483.52	2.36
16	601669	中国电建	1,089,238	8,572,303.06	2.26
17	600028	中国石化	1,904,820	7,771,665.60	2.05
18	600019	宝钢股份	1,268,100	7,633,962.00	2.01
19	600010	包钢股份	3,246,000	7,628,100.00	2.01
20	601857	中国石油	1,383,400	7,332,020.00	1.93
21	600256	广汇能源	654,435	6,897,744.90	1.82
22	601989	中国重工	1,623,300	6,022,443.00	1.59
23	600176	中国巨石	342,062	5,955,299.42	1.57
24	002202	金风科技	393,265	5,820,322.00	1.53
25	601877	正泰电器	153,100	5,477,918.00	1.44
26	600029	南方航空	722,000	5,277,820.00	1.39
27	601186	中国铁建	655,216	5,176,206.40	1.36
28	600885	宏发股份	118,780	4,970,943.00	1.31
29	601117	中国化学	522,000	4,912,020.00	1.29
30	600150	中国船舶	254,600	4,832,308.00	1.27
31	002738	中矿资源	51,890	4,805,532.90	1.26
32	601800	中国交建	501,832	4,657,000.96	1.23
33	600011	华能国际	626,300	4,409,152.00	1.16
34	601868	中国能建	1,847,400	4,378,338.00	1.15
35	000157	中联重科	706,933	4,354,707.28	1.15
36	000425	徐工机械	780,500	4,206,895.00	1.11
37	600487	亨通光电	268,960	3,910,678.40	1.03
38	601618	中国中冶	1,017,100	3,559,850.00	0.94
39	002353	杰瑞股份	81,800	3,296,540.00	0.87
40	000932	华菱钢铁	590,400	3,005,136.00	0.79
41	601727	上海电气	720,744	2,962,257.84	0.78
42	600039	四川路桥	273,700	2,882,061.00	0.76
43	600018	上港集团	463,755	2,703,691.65	0.71
44	601872	招商轮船	461,640	2,659,046.40	0.70
45	600362	江西铜业	147,700	2,633,491.00	0.69
46	002080	中材科技	95,600	2,629,000.00	0.69
47	600875	东方电气	158,200	2,602,390.00	0.68
48	000039	中集集团	174,840	2,421,534.00	0.64
49	600170	上海建工	761,200	2,306,436.00	0.61
50	002092	中泰化学	293,232	2,275,480.32	0.60
51	600026	中远海能	198,100	2,046,373.00	0.54
52	601975	招商南油	483,600	1,948,908.00	0.51
53	000400	许继电气	100,424	1,928,140.80	0.51
54	600580	卧龙电驱	131,200	1,891,904.00	0.50



55	600008	首创环保	627,100	1,818,590.00	0.48
56	300001	特锐德	103,800	1,796,778.00	0.47
57	000825	太钢不锈	324,400	1,767,980.00	0.47
58	600118	中国卫星	84,300	1,692,744.00	0.45
59	601866	中远海发	564,157	1,692,471.00	0.45
60	688009	中国通号	368,300	1,668,399.00	0.44
61	600021	上海电力	149,100	1,528,275.00	0.40
62	002266	浙富控股	305,790	1,464,734.10	0.39
63	601880	辽港股份	804,000	1,366,800.00	0.36
64	601179	中国西电	291,800	1,365,624.00	0.36
65	601018	宁波港	337,964	1,318,059.60	0.35
66	600583	海油工程	315,150	1,307,872.50	0.34
67	601808	中海油服	84,432	1,177,826.40	0.31
68	000877	天山股份	86,300	1,061,490.00	0.28
69	002281	光迅科技	59,800	1,051,284.00	0.28
70	000582	北部湾港	127,000	985,520.00	0.26
71	600320	振华重工	283,500	952,560.00	0.25
72	600312	平高电气	115,800	924,084.00	0.24
73	000528	柳工	139,260	906,582.60	0.24
74	600761	安徽合力	73,600	875,840.00	0.23
75	600717	天津港	206,290	827,222.90	0.22
76	603298	杭叉集团	49,200	759,156.00	0.20
77	600428	中远海特	152,700	726,852.00	0.19
78	600339	中油工程	239,100	690,999.00	0.18
79	600017	日照港	218,900	665,456.00	0.18
80	601228	广州港	176,700	648,489.00	0.17
81	001872	招商港口	32,200	502,320.00	0.13
82	600798	宁波海运	103,400	416,702.00	0.11
83	002554	惠博普	115,300	389,714.00	0.10

### 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	688048	长光华芯	2,007	224,723.79	0.06
2	301175	中科环保	41,082	156,933.24	0.04
3	301136	招标股份	7,172	141,575.28	0.04
4	688400	凌云光	6,329	138,794.97	0.04
5	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.03
6	688227	品高股份	4,060	86,965.20	0.02
7	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
8	688171	纬德信息	2,821	64,234.17	0.02
9	688267	中触媒	1,512	48,232.80	0.01

10	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
11	301187	欧圣电气	713	16,071.02	0.00
12	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
13	301217	铜冠铜箔	908	13,465.64	0.00
14	301127	天源环保	1,160	12,910.80	0.00
15	301117	佳缘科技	221	12,031.24	0.00
16	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
17	301207	华兰疫苗	209	11,791.78	0.00
18	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
19	301206	三元生物	245	11,194.05	0.00
20	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
21	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
22	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
23	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
24	301228	实朴检测	373	7,586.82	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	600885	宏发股份	4,722,511.00	1.34
2	601868	中国能建	4,642,203.00	1.32
3	600406	国电南瑞	4,413,976.61	1.25
4	600031	三一重工	4,120,249.00	1.17
5	000338	潍柴动力	3,723,282.00	1.06
6	688599	天合光能	3,673,135.89	1.04
7	000063	中兴通讯	3,528,889.00	1.00
8	601899	紫金矿业	3,474,789.28	0.98
9	600089	特变电工	3,417,684.00	0.97
10	600585	海螺水泥	3,279,264.19	0.93
11	600039	四川路桥	3,191,669.00	0.90
12	000932	华菱钢铁	3,176,830.00	0.90
13	600309	万华化学	3,086,251.00	0.87
14	601919	中远海控	3,048,754.30	0.86
15	601888	中国中免	3,045,486.00	0.86
16	601668	中国建筑	2,643,263.00	0.75
17	002080	中材科技	2,339,897.00	0.66
18	601390	中国中铁	2,162,732.00	0.61
19	601766	中国中车	2,154,996.57	0.61
20	600019	宝钢股份	2,008,778.22	0.57

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	600089	特变电工	3,707,784.99	1.05
2	601668	中国建筑	2,845,594.00	0.81
3	601899	紫金矿业	2,696,232.00	0.76
4	600406	国电南瑞	2,060,519.00	0.58
5	600820	隧道股份	1,962,005.32	0.56
6	600667	太极实业	1,838,715.00	0.52
7	600528	中铁工业	1,821,359.67	0.52
8	600970	中材国际	1,649,366.00	0.47
9	601669	中国电建	1,463,286.00	0.41
10	600585	海螺水泥	1,462,136.00	0.41
11	601390	中国中铁	1,456,427.00	0.41
12	600019	宝钢股份	1,433,664.00	0.41
13	601766	中国中车	1,369,078.00	0.39
14	600028	中国石化	1,354,586.00	0.38
15	601857	中国石油	1,312,007.00	0.37
16	600010	包钢股份	1,286,189.00	0.36
17	600256	广汇能源	1,078,079.00	0.31
18	600522	中天科技	1,040,202.00	0.29
19	601989	中国重工	1,036,672.00	0.29
20	601877	正泰电器	1,019,162.00	0.29

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	117,606,023.22
卖出股票收入（成交）总额	70,287,226.54

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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金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投资组合仓位调整的交易成本，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**

中国建筑股份有限公司在报告编制日前一年内受到惠州市交通运输局、江阴市住房和城乡建设局、重庆市住房和城乡建设委员会的处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

**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	18,824.28
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	216,608.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	235,432.64

## 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	688048	长光华芯	224,723.79	0.06	新股流通受限
2	301175	中科环保	141,236.86	0.04	新股未上市
2	301175	中科环保	15,696.38	0.00	新股流通受限
3	301136	招标股份	141,575.28	0.04	新股流通受限
4	688400	凌云光	138,794.97	0.04	新股未上市
5	688237	超卓航科	119,311.57	0.03	新股未上市

## 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(%)
鹏华中证一带一路主题指数(LOF)A	26,816	8,216.46	35,359,694.11	16.05	184,973,015.11	83.95
鹏华中证一带一路主题指数(LOF)C	128	2,710.70	-	-	346,969.31	100.00
合计	26,944	8,190.31	35,359,694.11	16.02	185,319,984.42	83.98

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

鹏华中证一带一路主题指数 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	赵体仁	167,316.00	3.35
2	李平	105,152.00	2.10
3	解福	92,030.00	1.84
4	孙锦杰	90,877.00	1.82
5	陈春兰	79,955.00	1.60
6	佟大双	71,553.00	1.43
7	李治	70,765.00	1.41
8	谢东运	56,824.00	1.14
9	吴少斌	53,302.00	1.07
9	谢启忠	53,302.00	1.07
9	李兆琨	53,302.00	1.07

注：持有人为场内持有人。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏华中证一带一路主题指数 (LOF) A	0.55	0.0000
	鹏华中证一带一路主题指数 (LOF) C	100.00	0.0288
	合计	100.55	0.0000

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	鹏华中证一带一路主题指数 (LOF) A	鹏华中证一带一路主题指数 (LOF) C
基金合同生效日 (2015年5月18日) 基金份额总额	606,402,064.93	-
本报告期期初基金份额总额	194,130,795.81	-
本报告期基金总申购	62,884,595.88	503,618.48

份额		
减：本报告期基金总赎回份额	36,682,682.47	156,649.17
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	220,332,709.22	346,969.31

## § 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。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 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(%)	
中泰证券	2	72,131,446.33	39.44	66,329.05	41.53	-

天风证券	2	66,598,497.16	36.41	54,883.63	34.36	-
浙商证券	1	22,366,977.66	12.23	20,552.81	12.87	-
国海证券	2	9,866,516.87	5.39	8,103.45	5.07	本报告期新增
开源证券	2	9,378,071.35	5.13	7,701.88	4.82	本报告期新增
华西证券	1	1,302,172.82	0.71	1,056.51	0.66	-
方正证券	2	636,687.44	0.35	580.22	0.36	-
兴业证券	1	630,707.00	0.34	511.70	0.32	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	本报告期新增
摩根大通证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	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(%)
中泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

### 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	鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(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
4	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
5	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
6	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

7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(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
13	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
14	鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(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
15	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
16	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
17	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
18	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

19	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
20	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
21	鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(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05月13日
22	鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(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05月13日
23	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
24	鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(LOF)基金合同	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年05月20日
25	关于鹏华基金管理有限公司旗下三只基金新增C类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告	《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20日
26	鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(LOF)更新的招募说明书(2022年第1号)	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年05月20日
27	鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(LOF)(C类基金份额)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05月20日
28	鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(LOF)(A类基金份额)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05月20日
29	鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(LOF)托管协议	《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20日
30	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
31	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
32	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

注：无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(LOF)基金合同》；
- (二)《鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(LOF)托管协议》；
- (三)《鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金(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。

鹏华基金管理有限公司

2022年8月30日