鹏华中证环保产业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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 其他指标 9
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 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 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 净资产（基金净值）变动表 16
6.4 报表附注 19
§7 投资组合报告 52
7.1 期末基金资产组合情况 52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 53
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 54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 59
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 59
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 59

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 59
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 59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 60
7.12 投资组合报告附注 60

§8 基金份额持有人信息 61

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 62
8.3 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 62

§9 开放式基金份额变动 62

§10 重大事件揭示 63

10.1 基金份额持有人大会决议 63
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 63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 63
10.4 基金投资策略的改变 63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 63
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 63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 63
10.8 其他重大事件 66

§11 影响投资者决策的其他重要信息 69

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 69

§12 备查文件目录 69

12.1 备查文件目录 69
12.2 存放地点 69
12.3 查阅方式 69

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证环保产业指数型证券投资基金(LOF)	
基金简称	鹏华中证环保产业指数(LOF)	
场内简称	环保产业基金	
基金主代码	160634	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 16 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	274,391,189.37 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏华中证环保产业指数(LOF)A	鹏华中证环保产业指数(LOF)C
下属分级基金的场内简称	环保产业基金	-
下属分级基金的交易代码	160634	015685
报告期末下属分级基金的份额总额	269,278,985.89 份	5,112,203.48 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	中证环保产业指数收益率×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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高永杰	李申
	联系电话	0755-81395402	021-60637102
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4006788999	021-60637111
传真		0755-82021126	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		何如	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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)	2022 年 05 月 10 日（基金合同生效日）-2022 年 06 月 30 日
	鹏华中证环保产业指数(LOF)A	鹏华中证环保产业指数(LOF)C
本期已实现收益	-3,845,941.96	6,410.15
本期利润	-21,126,087.13	485,418.02
加权平均基金份	-0.0747	0.3012

额本期利润		
本期加权平均净值利润率	-4.91%	25.02%
本期基金份额净值增长率	-2.39%	28.40%
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	-56,524,131.15	13,903.48
期末可供分配基金份额利润	-0.2099	0.0027
期末基金资产净值	461,188,894.24	6,564,489.42
期末基金份额净值	1.713	1.284
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	30.52%	28.40%

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

鹏华中证环保产业指数(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

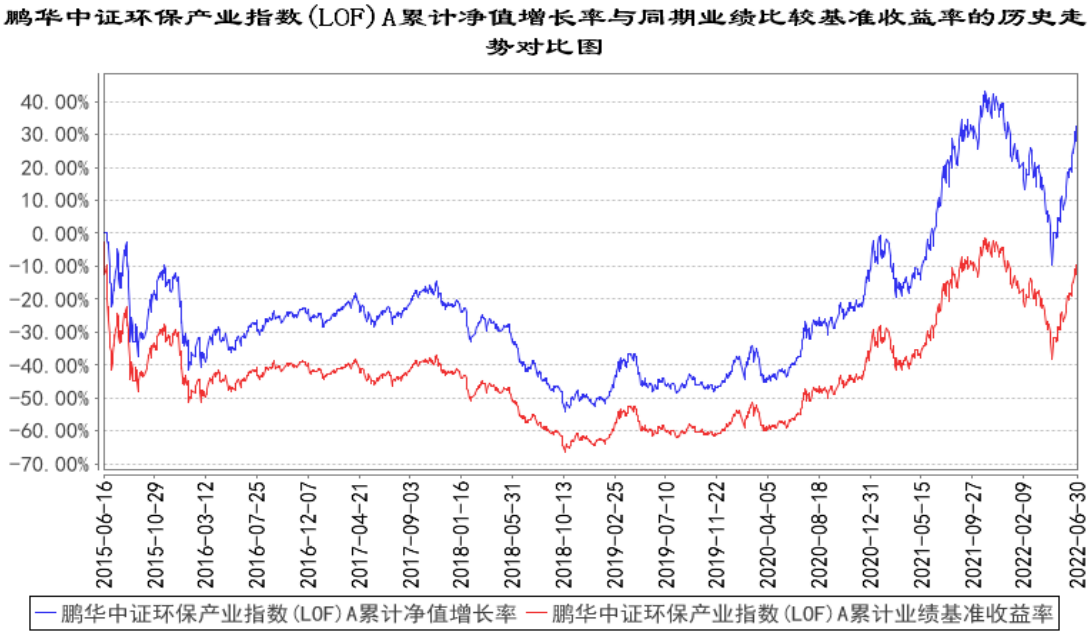
过去一个月	17.25%	1.69%	17.22%	1.70%	0.03%	-0.01%
过去三个月	14.43%	2.16%	14.22%	2.17%	0.21%	-0.01%
过去六个月	-2.39%	2.03%	-2.82%	2.05%	0.43%	-0.02%
过去一年	17.65%	1.96%	13.55%	1.99%	4.10%	-0.03%
过去三年	138.61%	1.75%	119.19%	1.77%	19.42%	-0.02%
自基金合同生效起至今	30.52%	1.76%	-10.93%	1.79%	41.45%	-0.03%

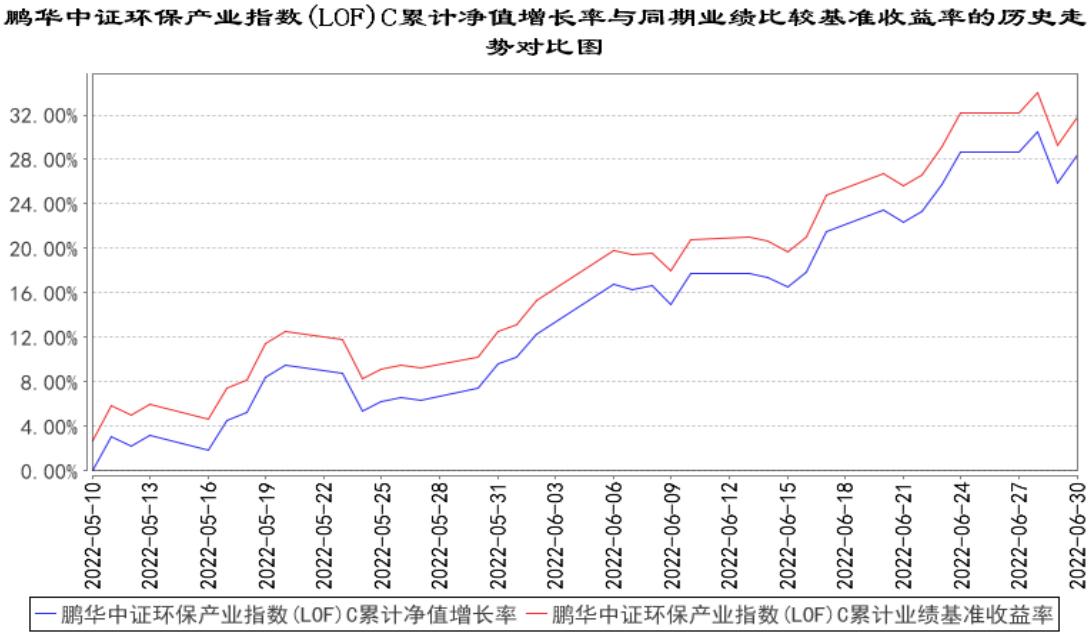
鹏华中证环保产业指数(LOF)C

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	17.15%	1.70%	17.22%	1.70%	-0.07%	0.00%
自基金合同生效起至今	28.40%	1.66%	31.85%	1.68%	-3.45%	-0.02%

注：业绩比较基准=中证环保产业指数收益率×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





注：1、本基金基金合同于 2015 年 06 月 16 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		
闫冬	基金经理	2019-03-19	-	12 年	闫冬先生，国籍中国，理学硕士，12 年证券从业经验。曾任招商期货有限公司资产管理部投资经理；2018 年 5 月加盟鹏华基金管理有限公司，现任量化及衍生品投资部基金经理。2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证酒指数分级证券投资基金基金经理,2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理,2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证信息技术指数分级证券投资基金基金经理,2019 年 04 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证 800 地产指数分级证券投资基金基金经理,2019 年 11 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证银行指数分级证券投资基金基金经理,2019 年 11 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证 A 股资源产业指数分级证券投资基金基金经理,2021 年 01 月至今担任鹏华中证 800 地产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 2021 年 01 月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

					华中证 A 股资源产业指数型证券投资基金(LOF)基金经理,2021 年 01 月至今担任鹏华中证环保产业指数型证券投资基金(LOF)基金经理,2021 年 02 月至今担任鹏华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2021 年 02 月至今担任鹏华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2021 年 03 月至今担任鹏华国证有色金属行业交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2021 年 04 月至今担任鹏华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2021 年 06 月至今担任鹏华中证车联网主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2021 年 07 月至今担任鹏华中证内地低碳经济主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2021 年 12 月至今担任鹏华中证沪港深科技龙头指数证券投资基金(LOF)基金经理,2022 年 03 月至今担任鹏华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,闫冬先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

报告期内，基金运作严格按照基金合同的各项要求，依据被动化指数投资方法进行投资管理。

报告期内，基金日均跟踪偏离度和跟踪误差都有较好的控制，较好地实现了基金运作目标。

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-2.39%，同期业绩比较基准增长率为-2.82%，C 类份额净值增长率为 28.40%，同期业绩比较基准增长率为 31.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观层面，上半年疫情对国内经济产生了明显影响，下半年国内宏观政策有望持续积极发力，经济基本面将逐步改善。同时对于海外市场，疫情后开放带来的经济修复动能正在减弱，美联储为抑制高通胀或继续加快加息节奏，甚至使经济出现衰退隐忧。相对来说，更看好下半年国内证券市场的表现。行业层面，重点关注困境反转、传统稳增长、新能源新基建等相关行业投资机会。对于低碳环保相关行业，随着全球摆脱传统能源束缚的诉求强烈，板块价值进一步凸显。全球需求共振下，光伏组件出口量高增。国内新能源汽车在疫情扰动后依然持续超预期。预计龙头企业业绩将持续改善，板块或将延续高景气。

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，本基金鹏华中证环保产业指数(LOF)A 期末可供分配利润为-56,524,131.15 元，期末基金份额净值 1.713 元，不符合利润分配条件；鹏华中证环保产业指数(LOF)C 期末可供分配利润为 13,903.48 元，期末基金份额净值 1.284 元。2、本基金本报告期内未进行利润分配。3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证环保产业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
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	31,174,375.16	32,035,237.46
结算备付金		71,586.17	994,876.36
存出保证金		54,962.03	95,935.26
交易性金融资产	6.4.7.2	441,772,054.32	501,991,626.05
其中：股票投资		441,772,054.32	501,991,626.05
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		18,593.46	1,253,967.42
应收股利		2,260.15	-
应收申购款		6,419,814.19	1,795,095.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	26,304.75	21,841.27
资产总计		479,539,950.23	538,188,579.09
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		-	-
应付赎回款		11,057,477.62	5,325,148.09
应付管理人报酬		361,067.24	450,825.59
应付托管费		79,434.78	99,181.63
应付销售服务费		750.60	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,899.46	3,570.86

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	284,936.87	626,899.12
负债合计		11,786,566.57	6,505,625.29
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	358,490,609.54	397,605,762.02
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	109,262,774.12	134,077,191.78
净资产合计		467,753,383.66	531,682,953.80
负债和净资产总计		479,539,950.23	538,188,579.09

注： 报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额为 274,391,189.37 份，其中鹏华中证环保产业指数(LOF)A 基金份额总额为 269,278,985.89 份，基金份额净值 1.713 元;鹏华中证环保产业指数(LOF)C 基金份额总额为 5,112,203.48 份，基金份额净值 1.284 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证环保产业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 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		-17,846,219.96	37,432,912.79
1.利息收入		539,253.24	21,981.49
其中：存款利息收入	6.4.7.13	50,776.20	21,981.49
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		488,477.04	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,128,836.92	18,236,688.15
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,520,666.79	17,881,660.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
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	1,391,829.87	355,027.32

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	-16,801,137.30	18,768,766.08
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	544,501.02	405,477.07
减：二、营业总支出		2,794,449.15	1,390,995.87
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	2,137,140.27	797,254.10
2．托管费	6.4.10.2.2	470,170.93	175,395.90
3．销售服务费	6.4.10.2.3	821.25	-
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		1,758.97	-
8．其他费用	6.4.7.23	184,557.73	418,345.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-20,640,669.11	36,041,916.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-20,640,669.11	36,041,916.92
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-20,640,669.11	36,041,916.92

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华中证环保产业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）	397,605,762.02	-	134,077,191.78	531,682,953.80
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）	397,605,762.02	-	134,077,191.78	531,682,953.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-39,115,152.48	-	-24,814,417.66	-63,929,570.14
（一）、综合收益总额	-	-	-20,640,669.11	-20,640,669.11
（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）	-39,115,152.48	-	-4,173,748.55	-43,288,901.03
其中：1.基金申购款	242,813,799.52	-	41,416,823.96	284,230,623.48
2.基金赎回款	-281,928,952.00	-	-45,590,572.51	-327,519,524.51
（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）	358,490,609.54	-	109,262,774.12	467,753,383.66
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）	186,789,956.62	-	-19,914,679.67	166,875,276.95
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）	186,789,956.62	-	-19,914,679.67	166,875,276.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-21,672,152.25	-	37,964,798.40	16,292,646.15
（一）、综合收益总额	-	-	36,041,916.92	36,041,916.92
（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）	-21,672,152.25	-	1,922,881.48	-19,749,270.77
其中：1.基金申购款	253,962,574.85	-	-14,784,792.75	239,177,782.10
2.基金赎回款	-275,634,727.10	-	16,707,674.23	-258,927,052.87

（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）	165,117,804.37	-	18,050,118.73	183,167,923.10

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

鹏华中证环保产业指数型证券投资基金(LOF)(原鹏华中证环保产业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 506 号《关于准予鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金注册的批复》准予，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《鹏华中证环保产业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 478,984,427.03 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 772 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 479,082,437.20 份基金份额，其中认购资金利息折合 98,010.17 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《鹏华中证环保产业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环保产业指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“鹏华环保份额”)、鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金之 A 份额(以下简称“鹏华环保 A 份额”)、鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金之 B 份额(以下简称“鹏华环保 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。鹏华环保份额为可以申购、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。鹏华环保 A 份额与鹏华环保 B 份额为可以上市交易但不能申购、赎回的基金份额，其中鹏华环保 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，鹏华环保 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。鹏华环保 A 份额与鹏华环保 B 份额的配比始终保持 1：1 的比率不变。本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环保份额；场内认购的份额将按照 1：1 的比例确认为鹏华环保 A 份额与鹏华环保 B 份额。本基金基金合同生效后，鹏华环保份额与鹏华环保 A 份额、鹏华环保 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环保份额按照 2 份鹏华环保份额对应 1 份鹏华环保 A 份额与 1 份鹏华环保 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环保 A 份额与鹏华环保 B 份额按照 1 份鹏华环保 A 份额与 1 份鹏华环保 B 份额对应 2 份鹏华环保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：鹏华环保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环保份额、鹏华环保 A 份额、鹏华环保 B 份额的份额数之和。鹏华环保 A 份额的基金份额净值为鹏华环保 A 份额的本金及约定应得收益之和。每 2 份鹏华环保份额所对应的基金资产净值等于 1 份鹏华环保 A 份额与 1 份鹏华环保 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。在鹏华环保 A 份额、鹏华环保份额存续期内的每个会计年度 11 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，鹏华环保 A 份额与鹏华环保 B 份额的份额配比保持 1：1 的比例。对于鹏华环保 A 份额的约定应得收益，即鹏华环保 A 份额每个会计年度 10 月 31 日基金份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内鹏华环保份额分配给鹏华环保 A 份额持有人。鹏华环保份额持有人持有的每 2 份鹏华环保份额将按 1 份鹏华环保 A 份额获得新增鹏华环保份额的分配。持有场外鹏华环保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环保份额的分配；持有场内鹏华环保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环保份额的分配。经过上述份额折算，鹏华环保 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，鹏华环保份额的基金份额净值将相应调整。

除定期份额折算外，本基金还将在鹏华环保份额的基金份额净值达到 1.500 元时或鹏华环保 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环保份额、鹏华环保 A 份额、鹏华环保 B 份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保鹏华环保 A 份额与鹏华环保 B 份额的比例为 1：1，份额折算后鹏华环保份额的基金份额净值、鹏华环保 A 份额与鹏华环保 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 291 号文审核同意，本基金鹏华环保 A 份额 109,870,294.00 份基金份额和鹏华环保 B 份额 109,870,294.00 份基金份额于 2015 年 6 月 26 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的鹏华环保份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为鹏华环保 A 份额和鹏华环保 B 份额即可上市流通；对于托管在场外的鹏华环保份额，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环保 A 份额和鹏华环保 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人向深交所申请鹏华环保 A 份额和鹏华环保 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]1090 号)。本基金管理人于 2020 年 12 月 2 日发布《关于鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金之鹏华环保 A 份额和鹏华环保 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，以鹏华环保份额的基金份额净值为基准，鹏华环保 A 份额、鹏华环保 B 份额按照各自的基金份额净值折算成鹏华环保份额的场内份额。

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，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，鹏华环保 A 份额和鹏华环保 B 份额终止运作后，于鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金折算基准日次日（2021 年 1 月 1 日）《鹏华中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《鹏华中证环保产业指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

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五只基金新增 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 10 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《鹏华中证环保产业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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证环保产业指数收益率×95%＋商业银行活期存款利率(税后)×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》、《鹏华中证环保产业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>》，本基金的的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a)金融工具

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

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

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

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

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

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

银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、其它资产、应付交易费用和其他负债，对其账面价值的影响金额分别为 3,397.11 元、492.47 元、47.52 元、-21,841.27 元、17,904.17 元、-392,601.82 元和 392,601.82 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	31,174,375.16
等于：本金	31,171,437.27
加：应计利息	2,937.89
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	31,174,375.16

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		408,369,567.09	-	441,772,054.32	33,402,487.23
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		408,369,567.09	-	441,772,054.32	33,402,487.23

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	26,304.75
待摊费用	-
合计	26,304.75

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	35,462.15
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	117,651.86
其中：交易所市场	117,651.86
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	284,936.87

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华中证环保产业指数(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	302,979,275.92	397,605,762.02
本期申购	179,413,575.35	235,447,043.58
本期赎回（以“-”号填列）	-213,113,865.38	-279,674,399.54
-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	269,278,985.89	353,378,406.06

鹏华中证环保产业指数(LOF)C

项目	本期 2022 年 5 月 10 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	7,366,755.94	7,366,755.94
本期赎回（以“-”号填列）	-2,254,552.46	-2,254,552.46
-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	5,112,203.48	5,112,203.48

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

鹏华中证环保产业指数(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	-59,328,272.03	193,405,463.81	134,077,191.78
本期利润	-3,845,941.96	-17,280,145.17	-21,126,087.13
本期基金份额交易产生的变动数	6,650,082.84	-11,790,699.31	-5,140,616.47
其中：基金申购款	-35,946,598.40	75,932,046.21	39,985,447.81
基金赎回款	42,596,681.24	-87,722,745.52	-45,126,064.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-56,524,131.15	164,334,619.33	107,810,488.18

鹏华中证环保产业指数(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	6,410.15	479,007.87	485,418.02
本期基金份额交易产生的变动数	7,493.33	959,374.59	966,867.92
其中：基金申购款	10,683.23	1,420,692.92	1,431,376.15
基金赎回款	-3,189.90	-461,318.33	-464,508.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,903.48	1,438,382.46	1,452,285.94

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	47,757.28
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	1,946.39
其他	1,072.53
合计	50,776.20

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,520,666.79
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	-3,520,666.79

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	126,975,521.08
减：卖出股票成本总额	130,150,922.96
减：交易费用	345,264.91
买卖股票差价收入	-3,520,666.79

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	1,391,829.87
其中：证券出借权益补偿收入	259,144.93
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,391,829.87

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	-16,801,137.30
股票投资	-16,801,137.30
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	-16,801,137.30

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	489,822.03
基金转换费收入	54,678.99
合计	544,501.02

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	2,734.87
指数使用费	100,000.00
合计	184,557.73

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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	1,061,233.76	0.51	18,641,417.04	12.58

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	967.26	0.51	967.26	0.82
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	16,988.45	12.58	15,245.54	20.03

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	2,137,140.27	797,254.10
其中：支付销售机构的客户维护费	852,834.61	311,048.11

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	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021

	月 30 日	年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	470,170.93	175,395.90

注：支付基金托管人中国建设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		
	鹏华中证环保产业指数(LOF)A	鹏华中证环保产业指数(LOF)C	合计
鹏华基金公司	-	84.11	84.11
合计	-	84.11	84.11
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		
	鹏华中证环保产业指数(LOF)A	鹏华中证环保产业指数(LOF)C	合计
鹏华基金公司	-	-	-
合计	-	-	-

注：鹏华中证环保产业指数(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环保产业指数(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

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国信证券	8,127,054.00	6,198.63	1,138,520.00	456.32
上年度可比期间				

2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-

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

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

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

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天）	费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国信证券	2022010700009611	东方日升	2022-1-7	110,160.00	4,000	14	0.032	137.09	-	
国信证券	2022012100008866	东方日升	2022-1-21	23,450.00	1,000	14	0.032	35.43	-	
国信证券	2022020700046815	东方日升	2022-2-7	22,620.00	1,000	14	0.032	28.15	-	
国信证券	2022022100037845	东方日升	2022-2-21	22,170.00	1,000	14	0.032	27.59	-	
国信证券	2022022300000921	东方日升	2022-2-23	233,867.00	9,700	14	0.032	291.03	-	
国信证券	2022030400000929	中信博	2022-3-4	422,000.00	4,000	14	0.032	525.16	-	
国信证券	202203070003	东方日升	2022-3-7	28,080.00	1,000	14	0.032	34.94	-	

	5360									
国信证券	2022030900018089	东方日升	2022-3-9	279,554.00	9,700	14	0.032	347.89	-	
国信证券	2022031800005616	中信博	2022-3-18	87,440.00	1,000	14	0.032	108.81	-	
国信证券	2022032100028439	东方日升	2022-3-21	26,280.00	1,000	14	0.032	37.37	-	
国信证券	2022032200000796	东方日升	2022-3-22	106,134.00	4,200	14	0.032	141.51	-	
国信证券	2022032300013739	东方日升	2022-3-23	252,006.00	9,700	14	0.032	313.61	-	
国信证券	2022040600062421	东方日升	2022-4-6	23,150.00	1,000	14	0.032	28.81	-	
国信证券	2022040600062423	东方日升	2022-4-6	97,230.00	4,200	14	0.032	121.00	-	
国信证券	2022040600051101	东方日升	2022-4-6	224,555.00	9,700	14	0.032	279.45	-	
国信证券	2022042000048444	东方日升	2022-4-20	197,201.00	9,700	14	0.032	262.94	-	
国信证券	2022042000048446	东方日升	2022-4-20	85,386.00	4,200	14	0.032	113.85	-	
国信证券	2022042000048448	东方日升	2022-4-20	20,330.00	1,000	14	0.032	27.11	-	
国信证券	2022050500072531	东方日升	2022-5-5	210,296.00	9,700	14	0.032	261.70	-	
国信证券	2022050500074235	东方日升	2022-5-5	91,056.00	4,200	14	0.032	113.31	-	
国信证券	2022050500074237	东方日升	2022-5-5	21,680.00	1,000	14	0.032	26.98	-	
国信证券	202205	东方日	2022-	261,803.	9,700	14	0.032	325.80	-	

	1900041435	升	5-19	00						
国信证券	2022051900041439	东方日升	2022-5-19	113,358.00	4,200	14	0.032	141.07	-	
国信证券	2022051900041441	东方日升	2022-5-19	26,990.00	1,000	14	0.032	33.59	-	
国信证券	2022060200013710	东方日升	2022-6-2	259,087.00	9,700	14	0.032	322.42	-	
国信证券	2022060200013714	东方日升	2022-6-2	112,182.00	4,200	14	0.032	139.60	-	
国信证券	2022061600017969	东方日升	2022-6-16	283,434.00	9,700	14	0.032	352.72	-	
国信证券	2022061600017971	东方日升	2022-6-16	122,724.00	4,200	14	0.032	152.72	-	
国信证券	2022063000020993	东方日升	2022-6-30	175,980.00	6,000	14	0.032	219.00	175,980.00	-
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	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天）	费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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
中国建设银行	31,174,375.16	47,757.28	16,357,854.91	19,925.93

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	300986	志特新材	网下申购	1,763	26,074.77

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	202	12,746.20	8,049.70	-
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	6 个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-

		日								
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	562	17,320.84	12,060.52	-
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通受限	33.68	43.98	353	11,889.04	15,524.94	-
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	41,368	158,025.76	158,025.76	-
301175	中科环保	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	3.82	3.82	4,597	17,560.54	17,560.54	-
301187	欧圣电气	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	21.33	22.54	835	17,810.55	18,820.90	-
301200	大族数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月	新股流通受限	76.56	51.92	246	18,833.76	12,772.32	-
301206	三元	2022 年	6 个月	新股流	109.30	45.69	354	25,794.80	16,174.26	三元生物

	生物	1 月 26 日		通受限						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	285	16,210.80	16,079.70	-
301217	铜冠铜箔	2022 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	17.27	14.83	1,223	21,121.21	18,137.09	-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	173.98	87.82	137	13,222.48	12,031.34	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	6 个月	新股流通受限	19.18	32.07	1,096	21,021.28	35,148.72	-

		日								
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	4,223	142,103.95	142,103.95	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股流通受限	33.65	33.65	470	15,815.50	15,815.50	-
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	559	15,931.50	19,492.33	-
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	344	17,898.32	19,408.48	-
688223	晶科能源	2022 年 1 月 19 日	6 个月	新股流通受限	5.00	14.47	44,446	222,230.00	643,133.62	-

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份，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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000155	川能动力	2022 年 7 月 11 日	22.15	16,000	354,400.00
2	000591	太阳能	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 11 日	8.35	75,100	627,085.00
3	000598	兴蓉环境	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 5 日	5.11	87,000	444,570.00
4	000875	吉电股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 8 日	6.95	83,500	580,325.00
5	000883	湖北能源	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	5.11	71,000	362,810.00
6	002056	横店东磁	2022 年 7 月 13 日	26.62	30,000	798,600.00
7	002074	国轩高科	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 7 日	45.60	48,000	2,188,800.00
8	002266	浙富控股	2022 年 7 月 5 日	4.79	100,000	479,000.00
9	002340	格林美	2022 年 7 月 5 日-2022	9.10	187,900	1,709,890

			年 7 月 14 日			.00
10	002506	协鑫集成	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 7 日	3.72	195,100	725,772.00
11	002518	科士达	2022 年 7 月 5 日	30.60	10,000	306,000.00
12	002531	天顺风能	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 6 日	16.49	41,000	676,090.00
13	002610	爱康科技	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	4.14	192,400	796,536.00
14	002709	天赐材料	2022 年 7 月 5 日-2022 年 7 月 6 日	62.06	42,100	2,612,726.00
15	003035	南网能源	2022 年 7 月 4 日	6.35	11,900	75,565.00
16	300014	亿纬锂能	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 7 日	97.50	16,400	1,599,000.00
17	300037	新宙邦	2022 年 7 月 12 日	52.56	18,600	977,616.00
18	300070	碧水源	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	5.21	83,000	432,430.00
19	300072	三聚环保	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	5.06	65,000	328,900.00
20	300073	当升科技	2022 年 7 月 1 日	90.34	7,000	632,380.00
21	300118	东方日升	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	29.33	26,400	774,312.00
22	300274	阳光电源	2022 年 7 月 7 日-2022 年 7 月 13 日	98.25	26,300	2,583,975.00
23	300316	晶盛机电	2022 年 7 月 5 日-2022 年 7 月 12 日	67.59	26,000	1,757,340.00
24	300457	赢合科技	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 8 日	28.41	18,200	517,062.00
25	300750	宁德时代	2022 年 7 月 4 日	534.00	33,000	17,622,000.00
26	300751	迈为股份	2022 年 7 月 14 日	490.90	2,000	981,800.00
27	301155	海力风电	2022 年 7 月 14 日	91.00	2,300	209,300.00
28	600008	首创环保	2022 年 7 月 5 日-2022 年 7 月 14 日	2.90	169,800	492,420.00
29	600025	华能水电	2022 年 7 月 5 日	6.99	80,000	559,200.00
30	600110	诺德股份	2022 年 7 月 7 日-2022 年 7 月 11 日	11.62	31,000	360,220.00
31	600116	三峡水	2022 年 7 月 6 日-2022	10.04	33,700	338,348.0

		利	年 7 月 7 日			0
32	600151	航天机电	2022 年 7 月 7 日	11.11	46,000	511,060.00
33	600163	中闽能源	2022 年 7 月 14 日-2022 年 7 月 14 日	8.45	28,600	241,670.00
34	600323	瀚蓝环境	2022 年 7 月 4 日	20.50	23,000	471,500.00
35	600438	通威股份	2022 年 7 月 11 日	59.86	55,000	3,292,300.00
36	600481	双良节能	2022 年 7 月 6 日	16.85	26,000	438,100.00
37	600674	川投能源	2022 年 7 月 5 日	11.92	45,000	536,400.00
38	600884	杉杉股份	2022 年 7 月 7 日-2022 年 7 月 14 日	29.72	39,400	1,170,968.00
39	600900	长江电力	2022 年 7 月 8 日	23.12	21,000	485,520.00
40	601016	节能风电	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	4.80	122,000	585,600.00
41	601158	重庆水务	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 4 日	5.35	27,400	146,590.00
42	601222	林洋能源	2022 年 7 月 7 日	8.35	70,000	584,500.00
43	601615	明阳智能	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	33.80	75,000	2,535,000.00
44	601865	福莱特	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	38.10	24,000	914,400.00
45	601908	京运通	2022 年 7 月 6 日	8.02	65,000	521,300.00
46	603218	日月股份	2022 年 7 月 5 日	25.40	22,000	558,800.00
47	603568	伟明环保	2022 年 7 月 4 日	33.37	16,000	533,920.00
48	603588	高能环境	2022 年 7 月 4 日	11.53	30,000	345,900.00
49	603659	璞泰来	2022 年 7 月 6 日	84.40	26,400	2,228,160.00
50	603806	福斯特	2022 年 7 月 8 日-2022 年 7 月 14 日	65.52	20,000	1,310,400.00
51	688005	容百科技	2022 年 7 月 5 日	129.44	9,000	1,164,960.00
52	688063	派能科技	2022 年 7 月 1 日	312.20	3,000	936,600.00
53	688116	天奈科	2022 年 7 月 8 日	169.48	3,500	593,180.0

		技				0
54	688339	亿华通-U	2022 年 7 月 6 日	98.38	1,400	137,732.00
55	688388	嘉元科技	2022 年 7 月 4 日	84.87	7,000	594,090.00
56	688390	固德威	2022 年 7 月 6 日	313.01	2,000	626,020.00
57	688408	中信博	2022 年 7 月 11 日	92.48	3,200	295,936.00
58	688516	奥特维	2022 年 7 月 5 日	266.95	1,500	400,425.00
59	688598	金博股份	2022 年 7 月 12 日	294.70	2,000	589,400.00
60	688599	天合光能	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 14 日	65.25	39,300	2,564,325.00
合计	-	-	-	-	2,683,400	68,219,228.00

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中国建设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	31,174,375.16	-	-	-	31,174,375.16
结算备付金	71,586.17	-	-	-	71,586.17
存出保证金	54,962.03	-	-	-	54,962.03
交易性金融资产	-	-	-	441,772,054.32	441,772,054.32
应收股利	-	-	-	2,260.15	2,260.15
应收申购款	-	-	-	6,419,814.19	6,419,814.19
应收清算款	-	-	-	18,593.46	18,593.46
其他资产	-	-	-	26,304.75	26,304.75
资产总计	31,300,923.36	-	-	448,239,026.87	479,539,950.23
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,057,477.62	11,057,477.62
应付管理人报酬	-	-	-	361,067.24	361,067.24
应付托管费	-	-	-	79,434.78	79,434.78

应付销售服务费	-	-	-	750.60	750.60
应交税费	-	-	-	2,899.46	2,899.46
其他负债	-	-	-	284,936.87	284,936.87
负债总计	-	-	-	11,786,566.57	11,786,566.57
利率敏感度缺口	31,300,923.36	-	-	436,452,460.30	467,753,383.66
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	32,035,237.46	-	-	-	32,035,237.46
结算备付金	994,876.36	-	-	-	994,876.36
存出保证金	95,935.26	-	-	-	95,935.26
交易性金融资产	-	-	-	501,991,626.05	501,991,626.05
应收申购款	-	-	-	1,795,095.27	1,795,095.27
应收清算款	-	-	-	1,253,967.42	1,253,967.42
其他资产	-	-	-	21,841.27	21,841.27
资产总计	33,126,049.08	-	-	505,062,530.01	538,188,579.09
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,325,148.09	5,325,148.09
应付管理人报酬	-	-	-	450,825.59	450,825.59
应付托管费	-	-	-	99,181.63	99,181.63
应交税费	-	-	-	3,570.86	3,570.86
其他负债	-	-	-	626,899.12	626,899.12
负债总计	-	-	-	6,505,625.29	6,505,625.29
利率敏感度缺口	33,126,049.08	-	-	498,556,904.72	531,682,953.80

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	441,772,054.32	94.45	501,991,626.05	94.42
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	441,772,054.32	94.45	501,991,626.05	94.42

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%	21,911,907.26	24,864,153.33
	业绩比较基准下降 5%	-21,911,907.26	-24,864,153.33

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	440,296,403.64

第二层次	398,941.27
第三层次	1,076,709.41
合计	441,772,054.32

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	441,772,054.32	92.12
	其中：股票	441,772,054.32	92.12
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	31,245,961.33	6.52
8	其他各项资产	6,521,934.58	1.36
9	合计	479,539,950.23	100.00

注：报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 68,219,228.00 元，占基金资产净值比为 14.58%。

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	-	-
C	制造业	355,997,794.11	76.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	75,478,204.00	16.14
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	-	-
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	871,220.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	7,901,031.60	1.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	440,248,249.71	94.12

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	1,095,346.88	0.23
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	75,319.14	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,586.82	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	187,632.32	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	157,919.45	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,523,804.61	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	300750	宁德时代	85,500	45,657,000.00	9.76
2	601012	隆基绿能	657,558	43,813,089.54	9.37
3	600900	长江电力	1,373,300	31,750,696.00	6.79
4	600438	通威股份	326,200	19,526,332.00	4.17

5	002812	恩捷股份	64,600	16,179,070.00	3.46
6	002129	TCL 中环	273,200	16,088,748.00	3.44
7	300014	亿纬锂能	136,821	13,340,047.50	2.85
8	300274	阳光电源	125,493	12,329,687.25	2.64
9	002709	天赐材料	162,728	10,098,899.68	2.16
10	002459	晶澳科技	113,220	8,933,058.00	1.91
11	688599	天合光能	130,850	8,537,962.50	1.83
12	300450	先导智能	132,160	8,349,868.80	1.79
13	601985	中国核电	1,138,200	7,808,052.00	1.67
14	603659	璞泰来	83,960	7,086,224.00	1.51
15	601615	明阳智能	203,200	6,868,160.00	1.47
16	600905	三峡能源	1,037,000	6,522,730.00	1.39
17	002074	国轩高科	120,600	5,499,360.00	1.18
18	002340	格林美	577,680	5,256,888.00	1.12
19	300316	晶盛机电	77,610	5,245,659.90	1.12
20	300769	德方纳米	12,600	5,149,368.00	1.10
21	002202	金风科技	333,429	4,934,749.20	1.05
22	300390	天华超净	49,700	4,343,780.00	0.93
23	603806	福斯特	64,252	4,209,791.04	0.90
24	688005	容百科技	32,330	4,184,795.20	0.89
25	300751	迈为股份	8,336	4,092,142.40	0.87
26	300568	星源材质	139,516	4,051,544.64	0.87
27	003816	中国广核	1,425,200	3,990,560.00	0.85
28	600884	杉杉股份	130,440	3,876,676.80	0.83
29	300073	当升科技	42,800	3,866,552.00	0.83
30	300763	锦浪科技	17,885	3,809,505.00	0.81
31	688116	天奈科技	22,387	3,794,148.76	0.81
32	600886	国投电力	360,100	3,781,050.00	0.81
33	603185	上机数控	23,220	3,622,087.80	0.77
34	300037	新宙邦	62,680	3,294,460.80	0.70
35	600732	爱旭股份	98,300	3,245,866.00	0.69
36	688063	派能科技	9,400	2,934,680.00	0.63
37	300919	中伟股份	22,000	2,725,800.00	0.58
38	002850	科达利	16,800	2,671,200.00	0.57
39	300724	捷佳伟创	29,400	2,626,890.00	0.56
40	002056	横店东磁	98,200	2,614,084.00	0.56
41	300118	东方日升	87,000	2,551,710.00	0.55
42	600674	川投能源	212,800	2,536,576.00	0.54
43	603026	石大胜华	17,100	2,485,485.00	0.53
44	688390	固德威	7,560	2,366,355.60	0.51
45	601865	福莱特	61,400	2,339,340.00	0.50
46	688598	金博股份	7,700	2,269,190.00	0.49

47	300438	鹏辉能源	36,800	2,261,360.00	0.48
48	002610	爱康科技	541,000	2,239,740.00	0.48
49	000591	太阳能	254,200	2,122,570.00	0.45
50	000155	川能动力	89,100	1,973,565.00	0.42
51	300035	中科电气	69,800	1,950,910.00	0.42
52	600110	诺德股份	167,800	1,949,836.00	0.42
53	002506	协鑫集成	494,600	1,839,912.00	0.39
54	002531	天顺风能	108,800	1,794,112.00	0.38
55	300393	中来股份	105,200	1,788,400.00	0.38
56	300776	帝尔激光	10,300	1,779,840.00	0.38
57	300850	新强联	19,880	1,769,916.40	0.38
58	601016	节能风电	363,200	1,743,360.00	0.37
59	600236	桂冠电力	285,600	1,739,304.00	0.37
60	002487	大金重工	40,200	1,677,546.00	0.36
61	688388	嘉元科技	19,680	1,670,241.60	0.36
62	600481	双良节能	98,200	1,654,670.00	0.35
63	000875	吉电股份	235,900	1,639,505.00	0.35
64	603568	伟明环保	47,220	1,575,731.40	0.34
65	600008	首创环保	531,930	1,542,597.00	0.33
66	600025	华能水电	217,400	1,519,626.00	0.32
67	603218	日月股份	58,420	1,483,868.00	0.32
68	601222	林洋能源	174,100	1,453,735.00	0.31
69	300409	道氏技术	55,900	1,452,282.00	0.31
70	601908	京运通	174,900	1,402,698.00	0.30
71	300070	碧水源	262,576	1,368,020.96	0.29
72	600151	航天机电	121,200	1,346,532.00	0.29
73	300457	赢合科技	47,050	1,336,690.50	0.29
74	688516	奥特维	4,800	1,281,360.00	0.27
75	603588	高能环境	108,068	1,246,024.04	0.27
76	002266	浙富控股	259,330	1,242,190.70	0.27
77	000883	湖北能源	238,000	1,216,180.00	0.26
78	688680	海优新材	6,100	1,212,070.00	0.26
79	600323	瀚蓝环境	59,057	1,210,668.50	0.26
80	300376	易事特	139,700	1,134,364.00	0.24
81	601778	晶科科技	209,700	1,132,380.00	0.24
82	000598	兴蓉环境	216,400	1,105,804.00	0.24
83	300185	通裕重工	376,500	1,080,555.00	0.23
84	300072	三聚环保	198,600	1,004,916.00	0.21
85	600116	三峡水利	92,300	926,692.00	0.20
86	688408	中信博	9,800	906,304.00	0.19
87	003035	南网能源	137,200	871,220.00	0.19
88	002518	科士达	28,100	859,860.00	0.18

89	688339	亿华通-U	8,540	840,165.20	0.18
90	601200	上海环境	81,250	825,500.00	0.18
91	002759	天际股份	29,500	801,810.00	0.17
92	600163	中闽能源	91,900	776,555.00	0.17
93	301155	海力风电	7,900	718,900.00	0.15
94	002534	西子洁能	26,700	434,943.00	0.09
95	601827	三峰环境	60,800	432,896.00	0.09
96	001289	龙源电力	18,200	396,032.00	0.08
97	601158	重庆水务	69,500	371,825.00	0.08
98	600032	浙江新能	25,100	367,715.00	0.08
99	603693	江苏新能	16,500	316,800.00	0.07
100	003039	顺控发展	8,200	198,030.00	0.04

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	688223	晶科能源	44,446	643,133.62	0.14
2	301175	中科环保	45,965	175,586.30	0.04
3	301239	普瑞眼科	4,693	157,919.45	0.03
4	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
5	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
6	301238	瑞泰新材	1,096	35,148.72	0.01
7	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.01
8	301268	铭利达	559	19,492.33	0.00
9	301302	华如科技	344	19,408.48	0.00
10	301187	欧圣电气	835	18,820.90	0.00
11	301217	铜冠铜箔	1,223	18,137.09	0.00
12	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
13	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
14	301206	三元生物	354	16,174.26	0.00
15	301207	华兰疫苗	285	16,079.70	0.00
16	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
17	301153	中科江南	353	15,524.94	0.00
18	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
19	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
20	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
21	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
22	301200	大族数控	246	12,772.32	0.00
23	301151	冠龙节能	562	12,060.52	0.00
24	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
25	301219	腾远钴业	137	12,031.34	0.00
26	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00

27	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
28	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
29	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
30	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
31	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
32	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
33	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
34	301110	青木股份	202	8,049.70	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

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	300750	宁德时代	11,364,056.00	2.14
2	601012	隆基绿能	5,563,686.80	1.05
3	600900	长江电力	4,491,427.41	0.84
4	300390	天华超净	3,838,292.00	0.72
5	601985	中国核电	3,527,739.00	0.66
6	002056	横店东磁	2,643,282.00	0.50
7	688599	天合光能	2,487,893.86	0.47
8	688598	金博股份	2,275,016.52	0.43
9	300919	中伟股份	2,120,871.24	0.40
10	688063	派能科技	2,010,800.88	0.38
11	600438	通威股份	1,921,254.00	0.36
12	002709	天赐材料	1,736,606.00	0.33
13	002812	恩捷股份	1,700,387.00	0.32
14	300274	阳光电源	1,663,846.00	0.31
15	300776	帝尔激光	1,610,169.00	0.30
16	002129	TCL 中环	1,580,060.00	0.30
17	300014	亿纬锂能	1,466,990.00	0.28
18	002487	大金重工	1,363,278.00	0.26
19	688680	海优新材	1,306,320.26	0.25
20	601615	明阳智能	1,039,344.00	0.20

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	601012	隆基绿能	16,603,011.48	3.12
2	600900	长江电力	9,772,059.00	1.84

3	300750	宁德时代	8,234,217.00	1.55
4	600438	通威股份	4,363,353.00	0.82
5	002812	恩捷股份	4,178,269.00	0.79
6	300274	阳光电源	3,648,714.00	0.69
7	300014	亿纬锂能	3,504,830.00	0.66
8	002129	TCL 中环	3,471,680.00	0.65
9	300450	先导智能	2,302,869.80	0.43
10	601985	中国核电	2,172,397.00	0.41
11	600416	湘电股份	2,029,587.00	0.38
12	600905	三峡能源	1,973,599.00	0.37
13	002459	晶澳科技	1,729,547.60	0.33
14	002709	天赐材料	1,663,182.00	0.31
15	688599	天合光能	1,601,348.70	0.30
16	603659	璞泰来	1,585,314.40	0.30
17	002340	格林美	1,443,540.00	0.27
18	000035	中国天楹	1,430,195.00	0.27
19	601615	明阳智能	1,417,857.00	0.27
20	002074	国轩高科	1,356,458.00	0.26

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	86,732,488.53
卖出股票收入（成交）总额	126,975,521.08

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

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	54,962.03
2	应收清算款	18,593.46
3	应收股利	2,260.15
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,419,814.19
6	其他应收款	26,304.75
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,521,934.58

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300750	宁德时代	17,622,000.00	3.77	转融通流通受限
2	600438	通威股份	3,292,300.00	0.70	转融通流通受限
3	002709	天赐材料	2,612,726.00	0.56	转融通流通受限
4	300274	阳光电源	2,583,975.00	0.55	转融通流通受限
5	300014	亿纬锂能	1,599,000.00	0.34	转融通流通受限
6	600900	长江电力	485,520.00	0.10	转融通流通受限

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688223	晶科能源	643,133.62	0.14	新股流通受限
2	301175	中科环保	158,025.76	0.03	新股未上市
2	301175	中科环保	17,560.54	0.00	新股流通受限
3	301239	普瑞眼科	142,103.95	0.03	新股未上市
3	301239	普瑞眼科	15,815.50	0.00	新股流通受限
4	301233	盛帮股份	58,875.36	0.01	新股未上市
4	301233	盛帮股份	6,560.16	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（%）
鹏华中证环保产业	119,358	2,256.06	130,440.15	0.05	269,148,545.74	99.95

指数(LOF)A						
鹏华中证环保产业指数(LOF)C	1,722	2,968.76	-	-	5,112,203.48	100.00
合计	121,080	2,266.20	130,440.15	0.05	274,260,749.22	99.95

8.2 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	鹏华中证环保产业指数(LOF)A	34,479.66	0.0128
	鹏华中证环保产业指数(LOF)C	19.12	0.0004
	合计	34,498.78	0.0126

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。

8.3 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	鹏华中证环保产业指数(LOF)A	鹏华中证环保产业指数(LOF)C
基金合同生效日（2015 年 6 月 16 日）基金份额总额	479,082,437.20	-
本报告期期初基金份额总额	302,979,275.92	-
本报告期基金总申购份额	179,413,575.35	7,366,755.94
减：本报告期基金总赎回份额	213,113,865.38	2,254,552.46
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	269,278,985.89	5,112,203.48

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司无重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

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(%)	
中信建投证券	2	72,556,426.89	35.09	66,680.30	35.23	-
华创证券	1	46,927,699.98	22.70	43,022.34	22.73	-
安信证券	2	26,503,055.85	12.82	24,152.24	12.76	-
中信证券	2	23,559,734.55	11.39	21,470.00	11.34	-
广发证券	1	18,734,027.	9.06	17,260.06	9.12	-

		50				
天风证券	1	9,728,969.90	4.71	8,866.24	4.68	-
中金公司	2	5,930,057.91	2.87	5,404.09	2.86	-
东方财富证券	2	1,766,231.16	0.85	1,433.00	0.76	-
国信证券	2	1,061,233.76	0.51	967.26	0.51	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-

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(%)
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于旗下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	《上海证券报》、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暂停客服电话服务的公告	《上海证券报》、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	鹏华中证环保产业指数型证券投资基金(LOF)2021 年第 4 季度报告	《上海证券报》、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	《上海证券报》、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	《上海证券报》、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	《上海证券报》、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	《上海证券报》、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	《上海证券报》、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	《上海证券报》、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	《上海证券报》、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	《上海证券报》、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	鹏华中证环保产业指数型证券投资基金(LOF)2021 年年度报告	《上海证券报》、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	《上海证券报》、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	《上海证券报》、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	鹏华中证环保产业指数型证券投资基金(LOF)2022 年第 1 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监	2022 年 04 月 21 日

		会基金电子披露网站	
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	《上海证券报》、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	《上海证券报》、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	《上海证券报》、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	《上海证券报》、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	《上海证券报》、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	关于鹏华基金管理有限公司旗下五只基金新增 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告	《上海证券报》、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 10 日
22	鹏华中证环保产业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）	《上海证券报》、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 10 日
23	鹏华中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）基金合同	《上海证券报》、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 10 日
24	鹏华中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）托管协议	《上海证券报》、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 10 日
25	鹏华中证环保产业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）	《上海证券报》、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 10 日
26	鹏华中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书（2022 年第 1 号）	《上海证券报》、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 10 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	《上海证券报》、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	《上海证券报》、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	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监	2022 年 06 月 06 日

	公司申购(含定期定额申购)费率优惠活动的公告	会基金电子披露网站	
30	鹏华中证环保产业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）	《上海证券报》、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 10 日
31	鹏华中证环保产业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）	《上海证券报》、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 10 日
32	鹏华中证环保产业指数型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书	《上海证券报》、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 10 日
33	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	《上海证券报》、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）《鹏华中证环保产业指数型证券投资基金(LOF)基金合同》；

（二）《鹏华中证环保产业指数型证券投资基金(LOF)托管协议》；

（三）《鹏华中证环保产业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