

鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：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

| | |
|---|-----------|
| § 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 | 7 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| 3.3 其他指标 | 8 |
| § 4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 10 |
| 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 | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 10 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 11 |
| 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 | 11 |
| § 5 托管人报告 | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 11 |
| 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 | 11 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见 | 12 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表 | 12 |
| 6.2 利润表 | 13 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 14 |
| 6.4 报表附注 | 17 |
| § 7 投资组合报告 | 42 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 42 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 43 |
| 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 | 44 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 48 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 50 |
| 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 | 50 |
| 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 | 50 |

| | | |
|-------------|-----------------------------------|-----------|
| 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 | 50 |
| 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 | 50 |
| 7.10 | 本基金投资股指期货的投资政策 | 50 |
| 7.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 50 |
| 7.12 | 投资组合报告附注 | 51 |
| § 8 | 基金份额持有人信息 | 52 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 52 |
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 52 |
| 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 | 52 |
| § 9 | 开放式基金份额变动 | 52 |
| § 10 | 重大事件揭示 | 53 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 | 53 |
| 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 | 53 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 53 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 | 53 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 53 |
| 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 | 53 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 53 |
| 10.8 | 其他重大事件 | 56 |
| § 11 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 58 |
| 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 | 58 |
| 11.2 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 58 |
| § 12 | 备查文件目录 | 58 |
| 12.1 | 备查文件目录 | 58 |
| 12.2 | 存放地点 | 59 |
| 12.3 | 查阅方式 | 59 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|----------------------|
| 基金名称 | 鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金 |
| 基金简称 | 鹏华沪深 300 指数增强 |
| 基金主代码 | 005870 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018 年 5 月 25 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 | 379,647,798.08 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

注：无。

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金为股票指数增强型基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | <p>1、股票投资策略 本基金为指数增强型基金，以沪深 300 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成份股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用多因子量化选股模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，力求实现超额收益。（1）多因子量化选股模型 本基金将以多因子量化选股模型构建股票组合。多因子模型针对个股构建价值、质量、动量、成长、一致预期等因子，通过量化方法处理因子与个股超额回报之间的特征关系，挑选出具有基本面逻辑支撑和统计意义有效的因子组合，进而得出具有稳定超额回报的股票组合。本基金对因子的有效性进行持续的跟踪，分析其变化规律，基金经理根据市场状况结合因子变化趋势，对模型使用的因子结构进行动态调整。（2）风险控制与调整 本基金为指数增强型基金。在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离过大的风险。基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度等因素的分析，对组合跟踪效果进行预估，及时调整投资组合，力求将跟踪误差控制在目标范围内。本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。（3）投资组合优化模型 本基金将综合考虑预期回报、风险及交易成本进行投资组合优化。选股范围以标的指数成份股为主，也包括非成份股中与成份股相关性强，流动性好，基本面信息充足的股票。（4）存托凭证投资策略 本基</p> |

| | |
|--------|--|
| | 金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 2、债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。 3、权证投资策略 本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。 4、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。 5、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×95%+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算） |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种。 |

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|--------------------------------|------------------------|
| 名称 | | 鹏华基金管理有限公司 | 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 | 《证券时报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.phfund.com.cn |
| 基金中期报告备置地点 | 深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司 |

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022年1月1日-2022年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | -33,233,931.10 |
| 本期利润 | 6,806,593.97 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0238 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.76% |
| 本期基金份额净值增长率 | -1.15% |
| 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 | 32,541,425.61 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0857 |
| 期末基金资产净值 | 554,676,309.54 |
| 期末基金份额净值 | 1.4610 |
| 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 | 46.10% |

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益等未实现收益。

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

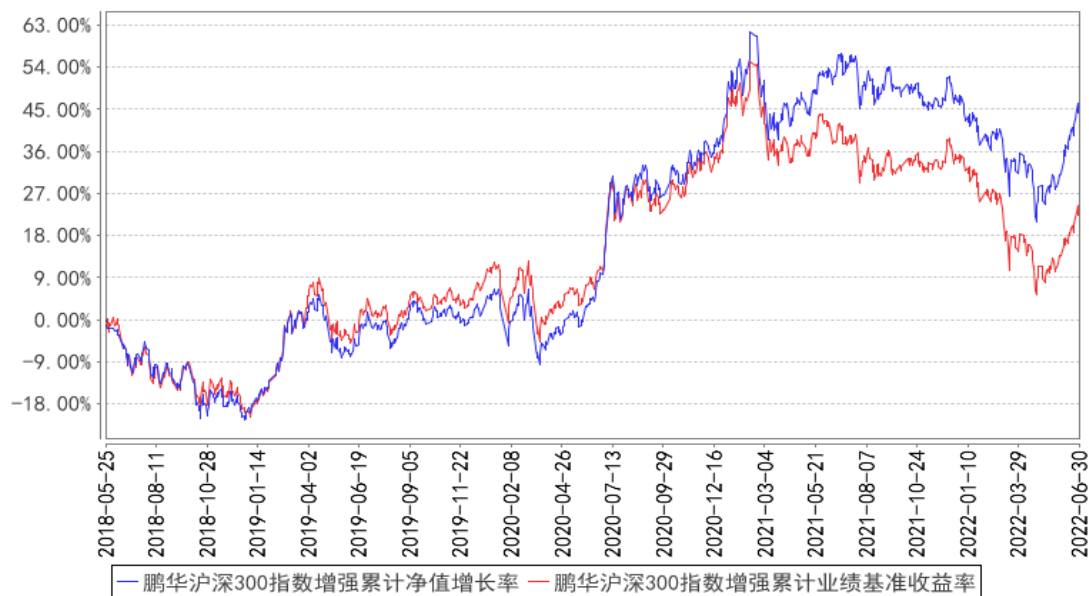
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | 11.63% | 1.01% | 9.26% | 1.02% | 2.37% | -0.01% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|---------|-------|--------|--------|
| 过去三个月 | 9.03% | 1.32% | 6.32% | 1.36% | 2.71% | -0.04% |
| 过去六个月 | -1.15% | 1.32% | -8.04% | 1.38% | 6.89% | -0.06% |
| 过去一年 | -6.86% | 1.14% | -12.10% | 1.18% | 5.24% | -0.04% |
| 过去三年 | 47.87% | 1.20% | 22.01% | 1.20% | 25.86% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 46.10% | 1.25% | 24.18% | 1.27% | 21.92% | -0.02% |

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×95%+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）

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

鹏华沪深300指数增强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 2018 年 05 月 25 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 | | |
| 苏俊杰 | 基金经理 | 2021-03-05 | - | 10 年 | 苏俊杰先生,国籍中国,理学硕士,10 年证券从业经验。曾任 MSCI INC. 分析师,华泰柏瑞基金管理有限公司专户投资经理,财通基金管理有限公司基金经理。2019 年 07 月加盟鹏华基金管理有限公司,现担任量化及衍生品投资部副总经理/基金经理。2021 年 03 月至今担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理,2021 年 03 月至今担任鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理,2022 年 01 月至今担任鹏华中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理,苏俊杰先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。 |

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注: 无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,在严格控制风险的

基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，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，本基金在控制相对沪深 300 指数跟踪误差的基础上，采用量化方法进行选股，力争在沪深 300 指数收益率的基础上进行增强。量化选股模型立足于上市公司的基本面信息，侧重于长期表现有效的因子类别，同时结合短期市场情绪、动量等因子，从而将模型的短期与长期有效性进行平衡与提高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为-1.15%，同期业绩比较基准增长率为-8.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，稳增长政策仍将持续发力，在中美经济周期背离的大背景下，国内货币环境仍将保持“以我为主”，处于相对宽松的状态，随着疫情的影响逐步消退，企业盈利增速有望在下半年企稳，宏观经济将呈现复苏态势。同时，国内的 CPI 处于相对较低的水平，尚不会对货币政策构成掣肘，是对权益市场最为有利的经济阶段和政策环境。从全球角度来说，低通胀复苏经济体同样极具稀缺性和吸引力，A 股的经济政策环境和盈利预期优势将吸引外资的不断增配。

未来市场从结构上看有望呈现行业轮动加速的震荡上行格局，主流宽基指数的风险收益性价比将会更加突显。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 32,541,425.61 元，期末基金份额净值 1.4610 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的真实、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：鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 46,608,928.29 | 44,273,837.67 |
| 结算备付金 | | 1,162,667.86 | 799,356.23 |
| 存出保证金 | | 98,329.08 | 110,327.25 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 513,177,897.53 | 374,295,237.62 |
| 其中：股票投资 | | 513,177,897.53 | 374,295,237.62 |
| 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 | | 75,523.78 | 583,322.12 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 2,354,799.90 | 74,203.40 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | 3,878.86 |
| 资产总计 | | 563,478,146.44 | 420,140,163.15 |
| 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 | | 5,039.43 | - |
| 应付赎回款 | | 7,519,456.26 | 14,235,244.69 |
| 应付管理人报酬 | | 387,201.15 | 344,536.53 |
| 应付托管费 | | 58,080.18 | 51,680.51 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 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 | 832,059.88 | 771,586.97 |
| 负债合计 | | 8,801,836.90 | 15,403,048.70 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 497,782,062.69 | 359,064,095.64 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 56,894,246.85 | 45,673,018.81 |
| 净资产合计 | | 554,676,309.54 | 404,737,114.45 |
| 负债和净资产总计 | | 563,478,146.44 | 420,140,163.15 |

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4610 元，基金份额总额 379,647,798.08 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 9,192,953.09 | 32,326,933.26 |
| 1. 利息收入 | | 73,403.91 | 49,430.79 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 73,403.91 | 49,430.79 |
| 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） | | -31,109,138.24 | 40,531,919.09 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -35,426,782.84 | 38,067,192.39 |

| | | | |
|---------------------------------|--------------|---------------------|----------------------|
| 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 | 4,317,644.60 | 2,464,726.70 |
| 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 | 40,040,525.07 | -8,607,253.08 |
| 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 | 188,162.35 | 352,836.46 |
| 减：二、营业总支出 | | 2,386,359.12 | 2,842,718.23 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,912,763.29 | 1,111,412.46 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 286,914.51 | 166,711.80 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 投资顾问费 | 6.4.10.2.1.1 | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产 支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 186,681.32 | 1,564,593.97 |
| 三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列） | | 6,806,593.97 | 29,484,215.03 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以 “-”号填列） | | 6,806,593.97 | 29,484,215.03 |
| 五、其他综合收益的税后 净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 6,806,593.97 | 29,484,215.03 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| | |

| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
|-------------------------------------|-----------------|--------|---------------|-----------------|
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 359,064,095.64 | - | 45,673,018.81 | 404,737,114.45 |
| 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） | 359,064,095.64 | - | 45,673,018.81 | 404,737,114.45 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 138,717,967.05 | - | 11,221,228.04 | 149,939,195.09 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 6,806,593.97 | 6,806,593.97 |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 138,717,967.05 | - | 4,414,634.07 | 143,132,601.12 |
| 其中：1. 基金申购款 | 301,243,962.42 | - | 6,868,407.18 | 308,112,369.60 |
| 2. 基金赎回款 | -162,525,995.37 | - | -2,453,773.11 | -164,979,768.48 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净 | - | - | - | - |

| | | | | |
|-------------------------------------|---------------------------------|--------|---------------|----------------|
| 值减少以“-”号填列) | | | | |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期末净资产(基金净值) | 497,782,062.69 | - | 56,894,246.85 | 554,676,309.54 |
| 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) | 285,014,012.59 | - | 25,494,416.60 | 310,508,429.19 |
| 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) | 285,014,012.59 | - | 25,494,416.60 | 310,508,429.19 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 2,735,438.96 | - | 31,008,298.34 | 33,743,737.30 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 29,484,215.03 | 29,484,215.03 |
| (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) | 2,735,438.96 | - | 1,524,083.31 | 4,259,522.27 |

| | | | | |
|--|-----------------|---|----------------|-----------------|
| 其中：1. 基金申购款 | 243,134,161.25 | - | 35,696,955.25 | 278,831,116.50 |
| 2. 基金赎回款 | -240,398,722.29 | - | -34,172,871.94 | -274,571,594.23 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期末净资产（基金净值） | 287,749,451.55 | - | 56,502,714.94 | 344,252,166.49 |

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

鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金是根据原鹏华新丝路指数分级证券投资基金(以下简称“鹏华新丝路分级基金”)基金份额持有人大会于 2018 年 4 月 2 日表决通过的《关于鹏华新丝路指数分级证券投资基金转型并修改基金合同等相关事项的议案》，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[2017]1621 号《关于准予鹏华新丝路指数分级证券投资基金变更注册的批复》核准，由鹏华新丝路分级基金转型而来。原鹏华新丝路分级基金存续期限至 2018 年 5 月 24 日止。自 2018 年 5 月 25 日起，原鹏华新丝路分级基金更名为鹏华沪深 300 指数

增强型证券投资基金(以下简称“本基金”),《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金合同》失效的同时《鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约开放式,存续期限不定。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。

原鹏华新丝路分级基金于基金合同失效前的基金资产净值为 7,510,455.69 元,已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金份额折算和变更登记结果暨鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同生效的公告》的有关规定,本基金的基金管理人于 2018 年 5 月 24 日日终折算完成后,对投资者持有的原鹏华新丝路分级基金的全部基金份额变更登记为本基金基金份额,基金份额总额为 7,509,131.55 份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券等)、货币市场工具(含同业存单等)、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以根据国家的有关规定进行融资及转融通。基金的投资组合比例为:投资于股票(含存托凭证)资产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(含存托凭证)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,基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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:沪深 300 指数收益率 \times 95%+1.5%(指年收益率,评价时按期间折算)。

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》、《鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2022

年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除 6.4.5.1 会计政策变更的说明所声明的变更外，本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

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

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

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

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

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

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

银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、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 3,428.52 元、395.67 元、54.67 元、-3,878.86 元、-498,080.30 元和 498,080.30 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 | 46,608,928.29 |
| 等于：本金 | 46,604,952.21 |
| 加：应计利息 | 3,976.08 |
| 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 | 46,608,928.29 |
|----|---------------|

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 | | 474,493,214.87 | - | 513,177,897.53 | 38,684,682.66 |
| 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 | | 474,493,214.87 | - | 513,177,897.53 | 38,684,682.66 |

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 | 27,695.95 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 670,061.37 |
| 其中：交易所市场 | 670,061.37 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 84,302.56 |
| 应付指数使用费 | 50,000.00 |
| 合计 | 832,059.88 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

| | 基金份额（份） | 账面金额 |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末 | 273,848,853.95 | 359,064,095.64 |
| 本期申购 | 229,752,501.42 | 301,243,962.42 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -123,953,557.29 | -162,525,995.37 |
| - 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 | 379,647,798.08 | 497,782,062.69 |

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

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|----------------|---------------|
| 本期期初 | 59,821,557.98 | -14,148,539.17 | 45,673,018.81 |
| 本期利润 | -33,233,931.10 | 40,040,525.07 | 6,806,593.97 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 5,953,798.73 | -1,539,164.66 | 4,414,634.07 |
| 其中：基金申购款 | 21,096,983.89 | -14,228,576.71 | 6,868,407.18 |
| 基金赎回款 | -15,143,185.16 | 12,689,412.05 | -2,453,773.11 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 32,541,425.61 | 24,352,821.24 | 56,894,246.85 |

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 | 51,553.31 |
| 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 | 9,426.51 |
| 其他 | 12,424.09 |
| 合计 | 73,403.91 |

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 | -35,426,782.84 |

| | |
|------------------|----------------|
| 入 | |
| 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 | -35,426,782.84 |

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 | 805,287,882.46 |
| 减：卖出股票成本总额 | 838,489,765.78 |
| 减：交易费用 | 2,224,899.52 |
| 买卖股票差价收入 | -35,426,782.84 |

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 | 4,317,644.60 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 4,317,644.60 |

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 | 40,040,525.07 |
| 股票投资 | 40,040,525.07 |
| 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 | 40,040,525.07 |

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 | 188,149.04 |
| 基金转换费收入 | 13.31 |
| 合计 | 188,162.35 |

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 审计费用 | 24,795.19 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费用 | 2,378.76 |
| 指数使用费 | 100,000.00 |
| 合计 | 186,681.32 |

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

注：无。

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

注：无。

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 | 1,912,763.29 | 1,111,412.46 |
| 其中：支付销售机构的客户维护 费 | 235,525.81 | 91,340.31 |

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 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 286,914.51 | 166,711.80 |

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 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 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 |
|---------------------------------|---------------------------------------|--|
| 基金合同生效日（2018 年 5 月 25 日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 13,463,125.53 | 13,463,125.53 |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 13,463,125.53 | 13,463,125.53 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 3.5462% | 6.1347% |

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

6.4.10.5.2 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 | 46,608,928.29 | 51,553.31 | 24,205,929.02 | 31,947.85 |

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 | 4,481 | 26,751.57 |
| 国信证券 | 300957 | 贝泰妮 | 网下申购 | 1,162 | 54,997.46 |

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 | 165 | 10,411.50 | 6,575.25 | - |
| 301112 | 信邦智能 | 2022 年 6 月 | 6 个月 | 新股流通受限 | 27.53 | 45.04 | 399 | 10,984.47 | 17,970.96 | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|-----------|--------|-------|-------|--------|------------|------------|--|---|
| | | 20 日 | | | | | | | | | |
| 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 | 258 | 12,074.40 | 14,045.52 | | - |
| 301120 | 新特电气 | 2022 年 4 月 11 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 13.73 | 15.49 | 1,032 | 14,169.36 | 15,985.68 | | - |
| 301125 | 腾亚精工 | 2022 年 5 月 27 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 22.49 | 27.42 | 327 | 7,354.23 | 8,966.34 | | - |
| 301135 | 瑞德智能 | 2022 年 4 月 1 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 31.98 | 26.26 | 338 | 10,809.24 | 8,875.88 | | - |
| 301151 | 冠龙节能 | 2022 年 3 月 30 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 30.82 | 21.46 | 473 | 14,577.86 | 10,150.58 | | - |
| 301153 | 中科江南 | 2022 年 5 月 10 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 33.68 | 43.98 | 373 | 12,562.64 | 16,404.54 | | - |
| 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 | 49,537 | 189,231.34 | 189,231.34 | | - |
| 301175 | 中科环保 | 2022 年 6 月 30 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 3.82 | 3.82 | 5,505 | 21,029.10 | 21,029.10 | | - |
| 301187 | 欧圣电气 | 2022 年 4 月 13 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 21.33 | 22.54 | 707 | 15,080.31 | 15,935.78 | | - |
| 301200 | 大族 | 2022 | 6 个月 | 新股流 | 76.56 | 51.92 | 200 | 15,312.00 | 10,384.00 | | - |

| | 数控 | 年 2 月 18 日 | | 通受限 | | | | | | |
|--------|------|-----------------------|------|------------|--------|-------|-------|-----------|-----------|--|
| 301206 | 三元生物 | 2022 年 1 月 26 日 | 6 个月 | 新股流 通受限 | 109.30 | 45.69 | 279 | 20,329.80 | 12,747.51 | 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 | 243 | 13,821.84 | 13,710.06 | - |
| 301217 | 铜冠铜箔 | 2022 年 1 月 20 日 | 6 个月 | 新股流 通受限 | 17.27 | 14.83 | 1,011 | 17,459.97 | 14,993.13 | - |
| 301219 | 腾远钴业 | 2022 年 3 月 10 日 | 6 个月 | 新股流 通受限 | 173.98 | 87.82 | 108 | 10,438.80 | 9,484.56 | 腾远钴业于 2022 年 5 月 24 日实施权益分派方案, 每 10 股派人民币 39.9 元, 并转增 8 股。 |
| 301220 | 亚香股份 | 2022 年 6 月 15 日 | 6 个月 | 新股流 通受限 | 35.98 | 39.15 | 285 | 10,254.30 | 11,157.75 | - |
| 301222 | 浙江恒威 | 2022 年 3 月 2 日 | 6 个月 | 新股流 通受限 | 33.98 | 28.96 | 332 | 11,281.36 | 9,614.72 | - |
| 301228 | 实朴检测 | 2022 年 1 月 21 日 | 6 个月 | 新股流 通受限 | 20.08 | 20.34 | 373 | 7,489.84 | 7,586.82 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|---------|--------|--------|--------|--------|------------|--------------|---|
| 301233 | 盛帮股份 | 2022年6月24日 | 1个月内(含) | 新股未上市 | 41.52 | 41.52 | 1,418 | 58,875.36 | 58,875.36 | - |
| 301233 | 盛帮股份 | 2022年6月24日 | 6个月 | 新股流通受限 | 41.52 | 41.52 | 158 | 6,560.16 | 6,560.16 | - |
| 301238 | 瑞泰新材 | 2022年6月10日 | 6个月 | 新股流通受限 | 19.18 | 32.07 | 1,103 | 21,155.54 | 35,373.21 | - |
| 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 | 472 | 13,452.00 | 16,458.64 | - |
| 301286 | 侨源股份 | 2022年6月6日 | 6个月 | 新股流通受限 | 16.91 | 19.79 | 784 | 13,257.44 | 15,515.36 | - |
| 301288 | 清研环境 | 2022年4月14日 | 6个月 | 新股流通受限 | 19.09 | 19.98 | 452 | 8,628.68 | 9,030.96 | - |
| 301298 | 东利机械 | 2022年5月27日 | 6个月 | 新股流通受限 | 12.68 | 20.83 | 634 | 8,039.12 | 13,206.22 | - |
| 301302 | 华如科技 | 2022年6月16日 | 6个月 | 新股流通受限 | 52.03 | 56.42 | 339 | 17,638.17 | 19,126.38 | - |
| 600938 | 中国海油 | 2022年4月14日 | 6个月 | 新股流通受限 | 10.80 | 15.86 | 84,004 | 907,243.20 | 1,332,303.44 | - |
| 688052 | 纳芯微 | 2022年4月14日 | 6个月 | 新股流通受限 | 230.00 | 350.81 | 870 | 200,100.00 | 305,204.70 | - |
| 688237 | 超卓航科 | 2022年6月 | 1个月内 | 新股未上市 | 41.27 | 41.27 | 2,891 | 119,311.57 | 119,311.57 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|----------|--------|-------|-------|-------|------------|------------|---|
| | | 24 日 | (含) | | | | | | | |
| 688259 | 创耀科技 | 2022 年 1 月 5 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 66.60 | 79.22 | 1,356 | 90,309.60 | 107,422.32 | - |
| 688283 | 坤恒顺维 | 2022 年 2 月 8 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 33.80 | 45.41 | 1,595 | 53,911.00 | 72,428.95 | - |
| 688320 | 禾川科技 | 2022 年 4 月 21 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 23.66 | 46.21 | 6,048 | 143,095.68 | 279,478.08 | - |
| 688400 | 凌云光 | 2022 年 6 月 27 日 | 1 个月内(含) | 新股未上市 | 21.93 | 21.93 | 7,731 | 169,540.83 | 169,540.83 | - |

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

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

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

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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。本基金主要投资于标的指数成份股，备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股(包括中小板，创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，存托凭证)，债券(含国债，金融债，企业债，公司债，央行票据，中期票据，短期融资券，超短期融资券，公开发行的次级债，可转换债券，可交换债券等)，货币市场工具(含同业存单等)，权证，资产支持证券，股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以根据国家的有关规定进行融资及转融通。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

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

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2021 年 12 月 31 日：未持有）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时或于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产

净值的 15%。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 | 46,608,928.29 | - | - | - | 46,608,928.29 |
| 结算备付金 | 1,162,667.86 | - | - | - | 1,162,667.86 |
| 存出保证金 | 98,329.08 | - | - | - | 98,329.08 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 513,177,897.53 | 513,177,897.53 |
| 应收申购款 | - | - | - | 2,354,799.90 | 2,354,799.90 |
| 应收清算款 | - | - | - | 75,523.78 | 75,523.78 |
| 资产总计 | 47,869,925.23 | - | - | 515,608,221.21 | 563,478,146.44 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 7,519,456.26 | 7,519,456.26 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 387,201.15 | 387,201.15 |

| | | | | | |
|--------------------------|---------------|-------|-------|-----------------|----------------|
| 应付托管费 | - | - | - | 58,080.18 | 58,080.18 |
| 应付清算款 | - | - | - | 5,039.43 | 5,039.43 |
| 其他负债 | - | - | - | 832,059.88 | 832,059.88 |
| 负债总计 | - | - | - | 8,801,836.90 | 8,801,836.90 |
| 利率敏感度缺口 | 47,869,925.23 | - | - | -506,806,384.31 | 554,676,309.54 |
| 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 | 44,273,837.67 | - | - | - | 44,273,837.67 |
| 结算备付金 | 799,356.23 | - | - | - | 799,356.23 |
| 存出保证金 | 110,327.25 | - | - | - | 110,327.25 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | -374,295,237.62 | 374,295,237.62 |
| 应收申购款 | - | - | - | 74,203.40 | 74,203.40 |
| 应收清算款 | - | - | - | 583,322.12 | 583,322.12 |
| 其他资产 | - | - | - | 3,878.86 | 3,878.86 |
| 资产总计 | 45,183,521.15 | - | - | -374,956,642.00 | 420,140,163.15 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 14,235,244.69 | 14,235,244.69 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 344,536.53 | 344,536.53 |
| 应付托管费 | - | - | - | 51,680.51 | 51,680.51 |
| 其他负债 | - | - | - | 771,586.97 | 771,586.97 |
| 负债总计 | - | - | - | 15,403,048.70 | 15,403,048.70 |
| 利率敏感度缺口 | 45,183,521.15 | - | - | -359,553,593.30 | 404,737,114.45 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%。因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券，所面临的其他价格风险来源于标的指数成份券和备选成份券证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个券在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份券及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

基金的投资组合比例为：投资于股票（含存托凭证）资产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（含存托凭证）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，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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 | 513,177,897.53 | 92.52 | 374,295,237.62 | 92.48 |
| 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 | 513,177,897.53 | 92.52 | 374,295,237.62 | 92.48 |

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% | 24,929,926.73 | 19,144,065.51 |
| | 业绩比较基准下降 5% | -24,929,926.73 | -19,144,065.51 |

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 | 509,947,590.86 |
| 第二层次 | 722,467.81 |
| 第三层次 | 2,507,838.86 |

| | |
|----|----------------|
| 合计 | 513,177,897.53 |
|----|----------------|

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 | 513,177,897.53 | 91.07 |
| | 其中：股票 | 513,177,897.53 | 91.07 |
| 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 | 47,771,596.15 | 8.48 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,528,652.76 | 0.45 |
| 9 | 合计 | 563,478,146.44 | 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 | 15,074,985.00 | 2.72 |
| C | 制造业 | 265,306,639.51 | 47.83 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,855,342.27 | 2.50 |
| E | 建筑业 | 15,891,956.00 | 2.87 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 14,187,383.80 | 2.56 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 16,707,816.47 | 3.01 |
| J | 金融业 | 89,520,254.77 | 16.14 |
| K | 房地产业 | 6,380,636.42 | 1.15 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 7,196,108.00 | 1.30 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 1,926,177.00 | 0.35 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 446,047,299.24 | 80.42 |

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 | 1,332,303.44 | 0.24 |
| C | 制造业 | 47,919,254.60 | 8.64 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 18,250.00 | 0.00 |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 1,031,203.28 | 0.19 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,560,984.00 | 0.46 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,928,451.45 | 0.35 |
| J | 金融业 | 11,937,713.97 | 2.15 |
| 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 | 236,931.28 | 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 | 67,130,598.29 | 12.10 |

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 | 600519 | 贵州茅台 | 9,870 | 20,184,150.00 | 3.64 |
| 2 | 002304 | 洋河股份 | 78,800 | 14,432,220.00 | 2.60 |
| 3 | 600438 | 通威股份 | 223,083 | 13,353,748.38 | 2.41 |
| 4 | 601601 | 中国太保 | 549,150 | 12,921,499.50 | 2.33 |
| 5 | 000568 | 泸州老窖 | 49,501 | 12,203,976.54 | 2.20 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 192,600 | 11,631,114.00 | 2.10 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 242,390 | 11,317,189.10 | 2.04 |
| 8 | 601668 | 中国建筑 | 2,073,900 | 11,033,148.00 | 1.99 |
| 9 | 600050 | 中国联通 | 3,185,864 | 11,023,089.44 | 1.99 |
| 10 | 002475 | 立讯精密 | 310,100 | 10,478,279.00 | 1.89 |
| 11 | 002466 | 天齐锂业 | 80,617 | 10,061,001.60 | 1.81 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 12 | 002352 | 顺丰控股 | 177,480 | 9,905,158.80 | 1.79 |
| 13 | 601985 | 中国核电 | 1,374,600 | 9,429,756.00 | 1.70 |
| 14 | 688008 | 澜起科技 | 152,484 | 9,237,480.72 | 1.67 |
| 15 | 002460 | 赣锋锂业 | 62,100 | 9,234,270.00 | 1.66 |
| 16 | 601658 | 邮储银行 | 1,691,000 | 9,114,490.00 | 1.64 |
| 17 | 601238 | 广汽集团 | 584,700 | 8,910,828.00 | 1.61 |
| 18 | 600919 | 江苏银行 | 1,204,200 | 8,573,904.00 | 1.55 |
| 19 | 601009 | 南京银行 | 821,900 | 8,564,198.00 | 1.54 |
| 20 | 600887 | 伊利股份 | 208,100 | 8,105,495.00 | 1.46 |
| 21 | 000858 | 五粮液 | 39,500 | 7,976,235.00 | 1.44 |
| 22 | 601319 | 中国人保 | 1,477,265 | 7,474,960.90 | 1.35 |
| 23 | 000625 | 长安汽车 | 430,730 | 7,460,243.60 | 1.34 |
| 24 | 601898 | 中煤能源 | 709,800 | 7,367,724.00 | 1.33 |
| 25 | 603259 | 药明康德 | 69,200 | 7,196,108.00 | 1.30 |
| 26 | 300750 | 宁德时代 | 12,876 | 6,875,784.00 | 1.24 |
| 27 | 600104 | 上汽集团 | 370,300 | 6,595,043.00 | 1.19 |
| 28 | 603392 | 万泰生物 | 42,184 | 6,551,175.20 | 1.18 |
| 29 | 600089 | 特变电工 | 233,500 | 6,395,565.00 | 1.15 |
| 30 | 002415 | 海康威视 | 173,900 | 6,295,180.00 | 1.13 |
| 31 | 300014 | 亿纬锂能 | 64,500 | 6,288,750.00 | 1.13 |
| 32 | 688599 | 天合光能 | 92,968 | 6,066,162.00 | 1.09 |
| 33 | 300122 | 智飞生物 | 53,656 | 5,956,352.56 | 1.07 |
| 34 | 002709 | 天赐材料 | 93,758 | 5,818,621.48 | 1.05 |
| 35 | 002050 | 三花智控 | 210,300 | 5,779,044.00 | 1.04 |
| 36 | 688981 | 中芯国际 | 126,587 | 5,717,934.79 | 1.03 |
| 37 | 300450 | 先导智能 | 89,300 | 5,641,974.00 | 1.02 |
| 38 | 603799 | 华友钴业 | 57,733 | 5,520,429.46 | 1.00 |
| 39 | 000063 | 中兴通讯 | 198,400 | 5,065,152.00 | 0.91 |
| 40 | 601288 | 农业银行 | 1,578,700 | 4,767,674.00 | 0.86 |
| 41 | 000001 | 平安银行 | 294,500 | 4,411,610.00 | 0.80 |
| 42 | 600809 | 山西汾酒 | 13,300 | 4,319,840.00 | 0.78 |
| 43 | 601328 | 交通银行 | 809,600 | 4,031,808.00 | 0.73 |
| 44 | 600030 | 中信证券 | 186,060 | 4,030,059.60 | 0.73 |
| 45 | 000596 | 古井贡酒 | 15,248 | 3,806,815.68 | 0.69 |
| 46 | 603185 | 上机数控 | 23,740 | 3,703,202.60 | 0.67 |
| 47 | 601390 | 中国中铁 | 602,200 | 3,697,508.00 | 0.67 |
| 48 | 600905 | 三峡能源 | 579,363 | 3,644,193.27 | 0.66 |
| 49 | 601857 | 中国石油 | 663,900 | 3,518,670.00 | 0.63 |
| 50 | 000661 | 长春高新 | 14,700 | 3,431,274.00 | 0.62 |
| 51 | 601166 | 兴业银行 | 172,000 | 3,422,800.00 | 0.62 |
| 52 | 601838 | 成都银行 | 203,200 | 3,369,056.00 | 0.61 |
| 53 | 002555 | 三七互娱 | 148,600 | 3,154,778.00 | 0.57 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 54 | 600018 | 上港集团 | 524,000 | 3,054,920.00 | 0.55 |
| 55 | 600048 | 保利发展 | 172,600 | 3,013,596.00 | 0.54 |
| 56 | 601336 | 新华保险 | 92,227 | 2,968,787.13 | 0.54 |
| 57 | 300207 | 欣旺达 | 93,600 | 2,957,760.00 | 0.53 |
| 58 | 300661 | 圣邦股份 | 16,100 | 2,930,522.00 | 0.53 |
| 59 | 300601 | 康泰生物 | 57,340 | 2,590,621.20 | 0.47 |
| 60 | 603659 | 璞泰来 | 29,500 | 2,489,800.00 | 0.45 |
| 61 | 601899 | 紫金矿业 | 263,700 | 2,460,321.00 | 0.44 |
| 62 | 601688 | 华泰证券 | 146,200 | 2,076,040.00 | 0.37 |
| 63 | 002821 | 凯莱英 | 7,000 | 2,023,000.00 | 0.36 |
| 64 | 000002 | 万科 A | 90,200 | 1,849,100.00 | 0.33 |
| 65 | 601088 | 中国神华 | 51,900 | 1,728,270.00 | 0.31 |
| 66 | 000938 | 紫光股份 | 81,200 | 1,575,280.00 | 0.28 |
| 67 | 601229 | 上海银行 | 239,000 | 1,565,450.00 | 0.28 |
| 68 | 688036 | 传音控股 | 16,865 | 1,504,863.95 | 0.27 |
| 69 | 600741 | 华域汽车 | 65,100 | 1,497,300.00 | 0.27 |
| 70 | 601728 | 中国电信 | 394,011 | 1,469,661.03 | 0.26 |
| 71 | 002371 | 北方华创 | 5,100 | 1,413,312.00 | 0.25 |
| 72 | 603882 | 金域医学 | 16,500 | 1,362,075.00 | 0.25 |
| 73 | 601186 | 中国铁建 | 147,000 | 1,161,300.00 | 0.21 |
| 74 | 000651 | 格力电器 | 31,700 | 1,068,924.00 | 0.19 |
| 75 | 601006 | 大秦铁路 | 158,100 | 1,041,879.00 | 0.19 |
| 76 | 601169 | 北京银行 | 200,601 | 910,728.54 | 0.16 |
| 77 | 688012 | 中微公司 | 7,789 | 909,365.75 | 0.16 |
| 78 | 000069 | 华侨城 A | 128,900 | 836,561.00 | 0.15 |
| 79 | 000877 | 天山股份 | 54,700 | 672,810.00 | 0.12 |
| 80 | 002410 | 广联达 | 12,000 | 653,280.00 | 0.12 |
| 81 | 600011 | 华能国际 | 82,100 | 577,984.00 | 0.10 |
| 82 | 300015 | 爱尔眼科 | 12,600 | 564,102.00 | 0.10 |
| 83 | 688111 | 金山办公 | 1,800 | 354,816.00 | 0.06 |
| 84 | 601138 | 工业富联 | 36,000 | 354,240.00 | 0.06 |
| 85 | 001979 | 招商蛇口 | 21,600 | 290,088.00 | 0.05 |
| 86 | 600383 | 金地集团 | 20,800 | 279,552.00 | 0.05 |
| 87 | 600025 | 华能水电 | 29,100 | 203,409.00 | 0.04 |
| 88 | 601919 | 中远海控 | 13,340 | 185,426.00 | 0.03 |
| 89 | 300316 | 晶盛机电 | 2,400 | 162,216.00 | 0.03 |
| 90 | 601155 | 新城控股 | 4,394 | 111,739.42 | 0.02 |
| 91 | 300124 | 汇川技术 | 900 | 59,283.00 | 0.01 |
| 92 | 300496 | 中科创达 | 400 | 52,192.00 | 0.01 |

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 | 600873 | 梅花生物 | 784,400 | 8,848,032.00 | 1.60 |
| 2 | 002240 | 盛新锂能 | 92,800 | 5,601,408.00 | 1.01 |
| 3 | 300803 | 指南针 | 85,100 | 5,002,178.00 | 0.90 |
| 4 | 300363 | 博腾股份 | 63,200 | 4,928,968.00 | 0.89 |
| 5 | 002807 | 江阴银行 | 1,072,500 | 4,858,425.00 | 0.88 |
| 6 | 300390 | 天华超净 | 50,800 | 4,439,920.00 | 0.80 |
| 7 | 601231 | 环旭电子 | 305,315 | 4,384,323.40 | 0.79 |
| 8 | 300171 | 东富龙 | 81,200 | 2,753,492.00 | 0.50 |
| 9 | 002497 | 雅化集团 | 84,000 | 2,742,600.00 | 0.49 |
| 10 | 600233 | 圆通速递 | 125,600 | 2,560,984.00 | 0.46 |
| 11 | 600875 | 东方电气 | 147,200 | 2,421,440.00 | 0.44 |
| 12 | 000733 | 振华科技 | 12,200 | 1,658,834.00 | 0.30 |
| 13 | 600141 | 兴发集团 | 37,400 | 1,645,226.00 | 0.30 |
| 14 | 300418 | 昆仑万维 | 90,100 | 1,441,600.00 | 0.26 |
| 15 | 688063 | 派能科技 | 4,466 | 1,394,285.20 | 0.25 |
| 16 | 300482 | 万孚生物 | 34,200 | 1,392,282.00 | 0.25 |
| 17 | 600938 | 中国海油 | 84,004 | 1,332,303.44 | 0.24 |
| 18 | 300861 | 美畅股份 | 13,700 | 1,269,853.00 | 0.23 |
| 19 | 601577 | 长沙银行 | 151,329 | 1,200,038.97 | 0.22 |
| 20 | 601933 | 永辉超市 | 238,900 | 1,022,492.00 | 0.18 |
| 21 | 600389 | 江山股份 | 15,900 | 965,607.00 | 0.17 |
| 22 | 601128 | 常熟银行 | 114,800 | 877,072.00 | 0.16 |
| 23 | 600487 | 亨通光电 | 48,680 | 707,807.20 | 0.13 |
| 24 | 000553 | 安道麦 A | 36,200 | 438,382.00 | 0.08 |
| 25 | 688235 | 百济神州-U | 4,083 | 405,564.39 | 0.07 |
| 26 | 688006 | 杭可科技 | 4,450 | 311,767.00 | 0.06 |
| 27 | 688052 | 纳芯微 | 870 | 305,204.70 | 0.06 |
| 28 | 688082 | 盛美上海 | 3,001 | 284,404.77 | 0.05 |
| 29 | 688320 | 禾川科技 | 6,048 | 279,478.08 | 0.05 |
| 30 | 301175 | 中科环保 | 55,042 | 210,260.44 | 0.04 |
| 31 | 688400 | 凌云光 | 7,731 | 169,540.83 | 0.03 |
| 32 | 688167 | 炬光科技 | 1,122 | 166,897.50 | 0.03 |
| 33 | 301239 | 普瑞眼科 | 4,693 | 157,919.45 | 0.03 |
| 34 | 688237 | 超卓航科 | 2,891 | 119,311.57 | 0.02 |
| 35 | 688259 | 创耀科技 | 1,356 | 107,422.32 | 0.02 |
| 36 | 688283 | 坤恒顺维 | 1,595 | 72,428.95 | 0.01 |
| 37 | 603236 | 移远通信 | 500 | 66,830.00 | 0.01 |
| 38 | 301233 | 盛帮股份 | 1,576 | 65,435.52 | 0.01 |
| 39 | 601089 | 福元医药 | 1,749 | 36,816.45 | 0.01 |
| 40 | 301238 | 瑞泰新材 | 1,103 | 35,373.21 | 0.01 |
| 41 | 301266 | 宇邦新材 | 517 | 24,335.19 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 42 | 688033 | 天宜上佳 | 934 | 19,838.16 | 0.00 |
| 43 | 301302 | 华如科技 | 339 | 19,126.38 | 0.00 |
| 44 | 600863 | 内蒙华电 | 5,000 | 18,250.00 | 0.00 |
| 45 | 301162 | 国能日新 | 334 | 18,072.74 | 0.00 |
| 46 | 301112 | 信邦智能 | 399 | 17,970.96 | 0.00 |
| 47 | 301268 | 铭利达 | 472 | 16,458.64 | 0.00 |
| 48 | 301153 | 中科江南 | 373 | 16,404.54 | 0.00 |
| 49 | 301120 | 新特电气 | 1,032 | 15,985.68 | 0.00 |
| 50 | 301187 | 欧圣电气 | 707 | 15,935.78 | 0.00 |
| 51 | 301286 | 侨源股份 | 784 | 15,515.36 | 0.00 |
| 52 | 301217 | 铜冠铜箔 | 1,011 | 14,993.13 | 0.00 |
| 53 | 301160 | 翔楼新材 | 392 | 14,762.72 | 0.00 |
| 54 | 301127 | 天源环保 | 1,314 | 14,624.82 | 0.00 |
| 55 | 301117 | 佳缘科技 | 258 | 14,045.52 | 0.00 |
| 56 | 301207 | 华兰疫苗 | 243 | 13,710.06 | 0.00 |
| 57 | 301298 | 东利机械 | 634 | 13,206.22 | 0.00 |
| 58 | 301206 | 三元生物 | 279 | 12,747.51 | 0.00 |
| 59 | 301259 | 艾布鲁 | 483 | 12,046.02 | 0.00 |
| 60 | 301116 | 益客食品 | 577 | 11,805.42 | 0.00 |
| 61 | 001268 | 联合精密 | 409 | 11,337.48 | 0.00 |
| 62 | 301220 | 亚香股份 | 285 | 11,157.75 | 0.00 |
| 63 | 301200 | 大族数控 | 200 | 10,384.00 | 0.00 |
| 64 | 301151 | 冠龙节能 | 473 | 10,150.58 | 0.00 |
| 65 | 301222 | 浙江恒威 | 332 | 9,614.72 | 0.00 |
| 66 | 301219 | 腾远钴业 | 108 | 9,484.56 | 0.00 |
| 67 | 301288 | 清研环境 | 452 | 9,030.96 | 0.00 |
| 68 | 301125 | 腾亚精工 | 327 | 8,966.34 | 0.00 |
| 69 | 301163 | 宏德股份 | 277 | 8,955.41 | 0.00 |
| 70 | 301135 | 瑞德智能 | 338 | 8,875.88 | 0.00 |
| 71 | 301166 | 优宁维 | 148 | 8,711.28 | 0.00 |
| 72 | 301158 | 德石股份 | 379 | 7,724.02 | 0.00 |
| 73 | 301228 | 实朴检测 | 373 | 7,586.82 | 0.00 |
| 74 | 301110 | 青木股份 | 165 | 6,575.25 | 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 | 002304 | 洋河股份 | 15,357,069.00 | 3.79 |
| 2 | 002466 | 天齐锂业 | 13,203,040.86 | 3.26 |
| 3 | 600438 | 通威股份 | 12,808,766.72 | 3.16 |
| 4 | 688008 | 澜起科技 | 12,450,426.67 | 3.08 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 5 | 601985 | 中国核电 | 12,122,134.00 | 3.00 |
| 6 | 601601 | 中国太保 | 12,100,229.00 | 2.99 |
| 7 | 002555 | 三七互娱 | 11,783,626.00 | 2.91 |
| 8 | 601238 | 广汽集团 | 11,656,905.00 | 2.88 |
| 9 | 002371 | 北方华创 | 11,642,339.00 | 2.88 |
| 10 | 601009 | 南京银行 | 11,616,841.00 | 2.87 |
| 11 | 000568 | 泸州老窖 | 11,612,008.53 | 2.87 |
| 12 | 300363 | 博腾股份 | 11,278,196.00 | 2.79 |
| 13 | 002709 | 天赐材料 | 11,108,267.60 | 2.74 |
| 14 | 002352 | 顺丰控股 | 10,943,502.60 | 2.70 |
| 15 | 603259 | 药明康德 | 10,589,440.00 | 2.62 |
| 16 | 688599 | 天合光能 | 10,570,268.37 | 2.61 |
| 17 | 601318 | 中国平安 | 10,515,956.47 | 2.60 |
| 18 | 300014 | 亿纬锂能 | 10,496,233.00 | 2.59 |
| 19 | 000333 | 美的集团 | 10,403,484.00 | 2.57 |
| 20 | 002475 | 立讯精密 | 10,250,968.00 | 2.53 |
| 21 | 601319 | 中国人保 | 10,217,876.52 | 2.52 |
| 22 | 002460 | 赣锋锂业 | 10,194,909.00 | 2.52 |
| 23 | 600089 | 特变电工 | 9,857,852.00 | 2.44 |
| 24 | 300661 | 圣邦股份 | 9,713,843.50 | 2.40 |
| 25 | 601668 | 中国建筑 | 9,269,959.00 | 2.29 |
| 26 | 601899 | 紫金矿业 | 9,017,770.00 | 2.23 |
| 27 | 601658 | 邮储银行 | 8,921,699.00 | 2.20 |
| 28 | 300347 | 泰格医药 | 8,496,822.00 | 2.10 |
| 29 | 000858 | 五粮液 | 8,416,582.00 | 2.08 |

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 | 002129 | TCL 中环 | 14,941,444.18 | 3.69 |
| 2 | 603986 | 兆易创新 | 14,151,944.48 | 3.50 |
| 3 | 002371 | 北方华创 | 13,429,211.84 | 3.32 |
| 4 | 600438 | 通威股份 | 12,655,553.00 | 3.13 |
| 5 | 002410 | 广联达 | 11,381,709.00 | 2.81 |
| 6 | 300059 | 东方财富 | 10,240,777.50 | 2.53 |
| 7 | 601009 | 南京银行 | 9,724,186.00 | 2.40 |
| 8 | 300347 | 泰格医药 | 9,234,704.60 | 2.28 |
| 9 | 300750 | 宁德时代 | 8,964,211.80 | 2.21 |
| 10 | 002709 | 天赐材料 | 8,946,457.00 | 2.21 |
| 11 | 600426 | 华鲁恒升 | 8,830,277.28 | 2.18 |
| 12 | 000725 | 京东方 A | 8,563,326.00 | 2.12 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 13 | 600030 | 中信证券 | 8,534,306.00 | 2.11 |
| 14 | 002555 | 三七互娱 | 8,490,066.20 | 2.10 |
| 15 | 300363 | 博腾股份 | 8,454,886.01 | 2.09 |
| 16 | 300124 | 汇川技术 | 8,438,567.59 | 2.08 |
| 17 | 601088 | 中国神华 | 8,273,814.68 | 2.04 |
| 18 | 000596 | 古井贡酒 | 8,222,401.00 | 2.03 |
| 19 | 601881 | 中国银河 | 8,069,478.96 | 1.99 |
| 20 | 603833 | 欧派家居 | 8,038,212.76 | 1.99 |

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 | 937,331,900.62 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 805,287,882.46 |

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

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 | 98,329.08 |
| 2 | 应收清算款 | 75,523.78 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 2,354,799.90 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,528,652.76 |

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

注：无。

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

| 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 (%) |
| 17,999 | 21,092.72 | 282,923,507.60 | 74.52 | 96,724,290.48 | 25.48 |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 154,723.19 | 0.0408 |

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

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|------------------------------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金 | - |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

注：1、截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研

究部门负责人未持有本基金份额。
2、截至本报告期末，本基金的基金经理投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2018 年 5 月 25 日) 基金份额总额 | 7,509,131.55 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 273,848,853.95 |
| 本报告期基金总申购份额 | 229,752,501.42 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 123,953,557.29 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 379,647,798.08 |

§ 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：

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 (%) | |
| 天风证券 | 2 | 1,629,529,749.54 | 94.05 | 1,164,602.05 | 92.75 | - |
| 浙商证券 | 1 | 37,930,480.77 | 2.19 | 34,946.04 | 2.78 | - |
| 开源证券 | 2 | 37,048,979.20 | 2.14 | 30,428.44 | 2.42 | 本报告期新增 |

| | | | | | | |
|--------|---|---------------|------|-----------|------|--------|
| 平安证券 | 1 | 28,140,256.77 | 1.62 | 25,644.03 | 2.04 | - |
| 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 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | 2 | - | - | - | - | 本报告期新增 |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 2 | - | - | - | - | 本报告期新增 |
| 摩根大通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 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 (%) |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 摩根大通 证券 | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 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 | 《证券时报》、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 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022 年 01 月 01 日 |
| 3 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与宁波银行股份有限公司易管家平台申购（不含定期定额投资）费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、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 20 日 |
| 4 | 鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告 | 《证券时报》、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基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022 年 01 月 21 日 |
| 6 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下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 | 《证券时报》、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 |
| 7 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 8 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部 | 《证券时报》、基金管 | 2022 年 02 月 21 日 |

| | | | |
|----|---|------------------------------|------------------|
| | 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 | 理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | |
| 9 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 10 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 11 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 12 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 13 | 鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金 2021 年年度报告 | 《证券时报》、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 |
| 14 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 15 | 鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告 | 《证券时报》、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 | 《证券时报》、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 |
| 17 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 18 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 19 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 20 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基 | 《证券时报》、基金管 | 2022 年 04 月 30 日 |

| | | | |
|----|--|------------------------------|------------------|
| | 金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告 | 理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | |
| 21 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 22 | 鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书 | 《证券时报》、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 | 鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要（更新） | 《证券时报》、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 | 《证券时报》、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 |
| 25 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 26 | 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 | 《证券时报》、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 |
| 27 | 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 | 《证券时报》、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)《鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金 2022 年中期报告》(原文)。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com.cn>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日