

# 鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

## 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
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
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>55</b>
7.1 期末基金资产组合情况	55
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	57
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67

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 .....	67
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 .....	67
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 .....	68
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 .....	68
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	68
7.12 投资组合报告附注 .....	68
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>69</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	69
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	70
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	70
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	70
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>70</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>71</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	71
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 .....	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	71
10.4 基金投资策略的改变 .....	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	71
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 .....	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	72
10.8 其他重大事件 .....	74
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>75</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	75
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>76</b>
12.1 备查文件目录 .....	76
12.2 存放地点 .....	76
12.3 查阅方式 .....	76

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)	
基金简称	鹏华沪深 300 指数 (LOF)	
场内简称	鹏华 300LOF	
基金主代码	160615	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2009 年 4 月 3 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,069,002,807.71 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2009 年 5 月 8 日	
下属分级基金的基金简称	鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)	鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)
下属分级基金的场内简称	鹏华 300LOF	-
下属分级基金的交易代码	160615	006939
报告期末下属分级基金的份额总额	975,547,396.03 份	93,455,411.68 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资方式, 追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化, 力争将日平均跟踪误差控制在 0.35% 以内, 以实现沪深 300 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法, 按照成份股在沪深 300 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和成份股发生配股、

	增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理，使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

注：无。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰
	联系电话	0755-81395402
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn
客户服务电话	4006788999	95588
传真	0755-82021126	(010)66105798
注册地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	何如	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)	鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)
本期已实现收益	-4,546,548.01	-489,664.95

本期利润	7,129,414.57	815,707.61
加权平均基金份额本期利润	0.0072	0.0084
本期加权平均净值利润率	0.56%	0.77%
本期基金份额净值增长率	0.58%	0.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	247,001,157.14	5,920,078.44
期末可供分配基金份额利润	0.2532	0.0633
期末基金资产净值	1,222,548,553.17	99,375,490.12
期末基金份额净值	1.2532	1.0633
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	109.12%	51.43%

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

鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)

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

	率①	准差②		④		
过去一个月	2.10%	0.81%	1.10%	0.83%	1.00%	-0.02%
过去三个月	-3.54%	0.77%	-4.88%	0.79%	1.34%	-0.02%
过去六个月	0.58%	0.78%	-0.68%	0.80%	1.26%	-0.02%
过去一年	-11.26%	0.92%	-13.58%	0.94%	2.32%	-0.02%
过去三年	7.92%	1.13%	-7.02%	1.14%	14.94%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	109.12%	1.38%	49.48%	1.37%	59.64%	0.01%

## 鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)

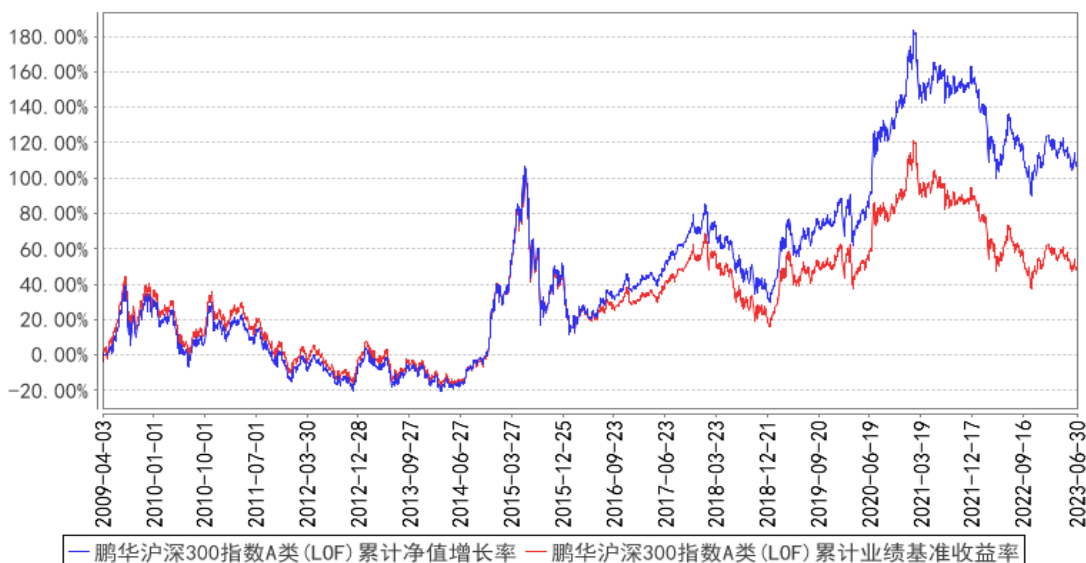
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.08%	0.81%	1.10%	0.83%	0.98%	-0.02%
过去三个月	-3.60%	0.77%	-4.88%	0.79%	1.28%	-0.02%
过去六个月	0.47%	0.78%	-0.68%	0.80%	1.15%	-0.02%
过去一年	-11.44%	0.91%	-13.58%	0.94%	2.14%	-0.03%
过去三年	7.25%	1.13%	-7.02%	1.14%	14.27%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	51.43%	1.18%	20.17%	1.19%	31.26%	-0.01%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%

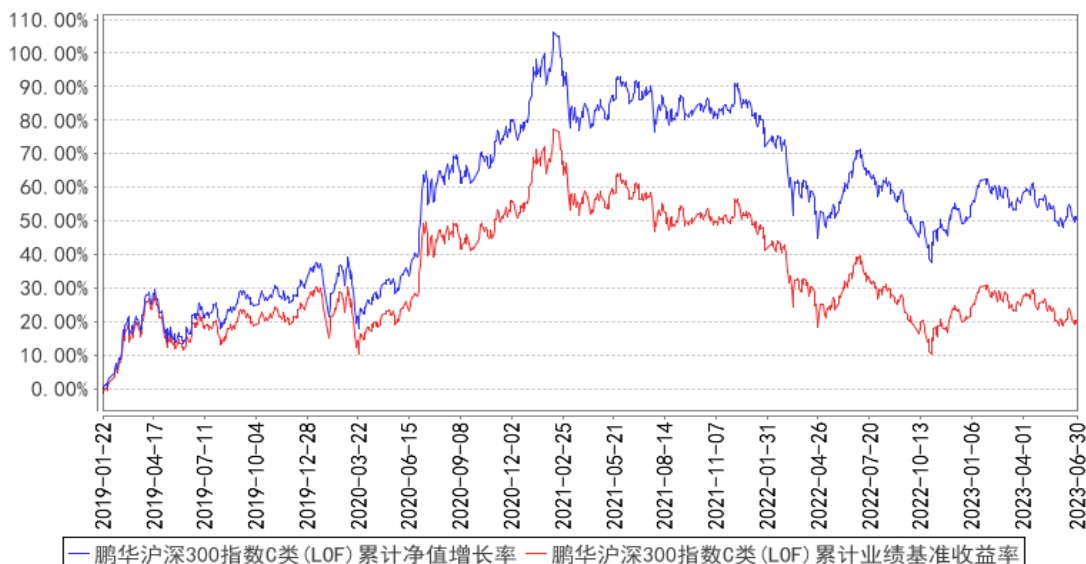


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鹏华沪深300指数A类 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鹏华沪深300指数C类 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2009 年 04 月 03 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 6 月 30 日, 公司管理资产总规模达到 11517 亿元, 301 只公募基金、13 只全国社保投资组合、7 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金, 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	2022-08-03	-	11 年	苏俊杰先生, 国籍中国, 理学硕士, 11 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, 历任量化及衍生品投资部副总经理, 现担任量化及衍生品投资部总经理/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, 2022 年 08 月至今担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 08 月至今担任鹏华创业板指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 08 月至今担任鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 02 月至今担任鹏华国证 2000 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。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF) 份额净值增长率为 0.58%，同期业绩比较基准增长率为 -0.68%，鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF) 份额净值增长率为 0.47%，同期业绩比较基准增长率为 -0.68%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年，市场对于经济复苏的预期不断修正，指数宽幅震荡以结构性机会为主，A 股

市场呈现出存量交易的特征，热点分化、轮动快，使得上半年市场整体的赚钱效应一般。

海外方面，美债收益率持续深度倒挂，利率维持高位，表观上看通胀回落速度较为温和，经济韧性较强，但我们认为利率维持高位的时间越久的同时也蕴含着更大的系统性金融风险，美联储本轮加息可能已经进入尾声。

展望下半年，尽管市场风险偏好仍然处于低位，但是边际上的积极因素也在不断增加，经济基本面温和复苏的态势仍将延续，权益市场估值低位，股债性价比处于历史高位，A 股赚钱效应有望回归；此外，美联储如果停止加息甚至开启宽松周期，将提升全球股市的风险偏好，外资也将重新回到净流入的状态，利好上半年调整幅度较大的核心资产。

#### 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，鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF) 期末可供分配利润为 247,001,157.14 元，期末基金份额净值 1.2532 元；鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF) 期末可供分配利润为 5,920,078.44 元，期末基金份额净值 1.0633 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	102,913,180.51	115,588,055.13
结算备付金		35,754.34	35,433.06
存出保证金		73,883.20	211,820.49
交易性金融资产	6.4.7.2	1,220,783,840.77	1,256,869,577.50
其中：股票投资		1,220,783,840.77	1,256,869,577.50
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		1,188.19	178,112.49
应收股利		140,433.87	-
应收申购款		237,917.39	246,066.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	45,944.46	35,893.59
资产总计		1,324,232,142.73	1,373,164,958.47
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		79.20	-
应付赎回款		991,435.58	19,783,967.95
应付管理人报酬		812,832.14	920,605.37
应付托管费		162,566.45	184,121.08
应付销售服务费		16,296.10	18,922.32
应付投资顾问费		-	-
应交税费		10,211.50	6,211.77
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	314,678.47	940,543.60
负债合计		2,308,099.44	21,854,372.09
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,069,002,807.71	1,100,436,117.66
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	252,921,235.58	250,874,468.72
净资产合计		1,321,924,043.29	1,351,310,586.38
负债和净资产总计		1,324,232,142.73	1,373,164,958.47

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额为 1,069,002,807.71 份，其中鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF) 基金份额总额为 975,547,396.03 份，基金份额净值 1.2532 元；鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF) 基金份额总额为 93,455,411.68 份，基金份额净值 1.0633 元。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		14,326,470.38	-2,753,693.83
1. 利息收入		1,344,021.21	373,238.85
其中：存款利息收入	6.4.7.13	176,104.93	373,238.85
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		1,167,916.28	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-83,640.68	-6,932,535.31
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-14,483,166.93	-32,037,028.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	14,399,526.25	25,104,493.55
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	12,981,335.14	3,538,729.68
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	84,754.71	266,872.95
<b>减：二、营业总支出</b>		6,381,348.20	9,446,847.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,134,849.03	7,735,830.41
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,026,969.87	1,547,166.13
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	105,748.53	64,150.13
4. 投资顾问费		-	-
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		4,204.83	-
8. 其他费用	6.4.7.23	109,575.94	99,701.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,945,122.18	-12,200,541.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,945,122.18	-12,200,541.61
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,945,122.18	-12,200,541.61

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	1,100,436,117.66	-	250,874,468.72	1,351,310,586.38
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）	1,100,436,117.66	-	250,874,468.72	1,351,310,586.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-31,433,309.95	-	2,046,766.86	-29,386,543.09
（一）、综合收	-	-	7,945,122.18	7,945,122.18



益总额				
(二)、 本期基金份额 交易产生的基金 净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)	-31,433,309.95	-	-5,898,355.32	-37,331,665.27
其中:1. 基金申购款	84,791,455.48	-	16,519,931.61	101,311,387.09
2 .基金赎回款	-116,224,765.43	-	-22,418,286.93	-138,643,052.36
(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)	1,069,002,807.71	-	252,921,235.58	1,321,924,043.29
项目	上年度可比期间 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	850,448,810.69	-	844,832,336.44	1,695,281,147.13

金净值)				
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	850,448,810.69	-	844,832,336.44	1,695,281,147.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	794,854,608.25	-	79,434,897.21	874,289,505.46
(一)、综合收益总额	-	-	-12,200,541.61	-12,200,541.61
(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)	794,854,608.25	-	512,251,510.86	1,307,106,119.11
其中:1.基金申购款	1,009,838,059.62	-	656,468,474.53	1,666,306,534.15
2.基金赎回款	-214,983,451.37	-	-144,216,963.67	-359,200,415.04
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-	-420,616,072.04	-420,616,072.04

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)	1,645,303,418.94	-	924,267,233.65	2,569,570,652.59

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：

<u>邓召明</u>	<u>邢彪</u>	<u>郝文高</u>
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 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”), 系经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 证监许可[2009]41 号文《关于核准鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 募集的批复》的核准, 由基金管理人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《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的约定募集设立。本基金为上市契约型开放式, 存续期限为不定期, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,994,133,345.09 元, 业经普华永道中天会计师事务所有限公司验证并出具普华永道中天验字(2009)第 051 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2009 年 4 月 3 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 1,994,428,997.48 份基金份额, 其中认购资金利息折合 295,652.39 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

### 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”)、《资产管理产品相关会计处

理规定》(财会[2022]14号)、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 2023 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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年的经营成果和基金净资产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

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

无。

##### 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	102,913,180.51
等于：本金	102,904,586.66
加：应计利息	8,593.85
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	102,913,180.51

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,371,513,616.99	-	1,220,783,840.77	-150,729,776.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,371,513,616.99	-	1,220,783,840.77	-150,729,776.22

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 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	45,944.46
待摊费用	-
合计	45,944.46

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	864.55
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	204,717.98
其中：交易所市场	204,717.98
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用	109,095.94
合计	314,678.47

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	994,616,080.28	994,616,080.28
本期申购	42,067,773.72	42,067,773.72
本期赎回 (以“-”号填列)	-61,136,457.97	-61,136,457.97
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	975,547,396.03	975,547,396.03

##### 鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	105,820,037.38	105,820,037.38
本期申购	42,723,681.76	42,723,681.76
本期赎回 (以“-”号填列)	-55,088,307.46	-55,088,307.46
-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	93,455,411.68	93,455,411.68

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

##### 鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	841,297,146.44	-596,593,932.28	244,703,214.16
本期利润	-4,546,548.01	11,675,962.58	7,129,414.57
本期基金份额交易产生的变动数	-16,125,673.98	11,294,202.39	-4,831,471.59
其中：基金申购款	35,469,093.56	-23,201,202.73	12,267,890.83



基金赎回款	-51,594,767.54	34,495,405.12	-17,099,362.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	820,624,924.45	-573,623,767.31	247,001,157.14

## 鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,843,060.56	-5,671,806.00	6,171,254.56
本期利润	-489,664.95	1,305,372.56	815,707.61
本期基金份额交易产生的变动数	-1,365,398.40	298,514.67	-1,066,883.73
其中：基金申购款	4,654,187.30	-402,146.52	4,252,040.78
基金赎回款	-6,019,585.70	700,661.19	-5,318,924.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,987,997.21	-4,067,918.77	5,920,078.44

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	172,557.72
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	1,142.26
其他	2,404.95
合计	176,104.93

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-14,483,166.93
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	-14,483,166.93

## 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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	168,351,764.18
减：卖出股票成本总额	182,379,882.11

减：交易费用	455,049.00
买卖股票差价收入	-14,483,166.93

#### 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	14,399,526.25
其中：证券出借权益补偿收入	973,435.03
基金投资产生的股利收益	-
合计	14,399,526.25

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	12,981,335.14
股票投资	12,981,335.14
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	12,981,335.14

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	83,275.81
基金转换费收入	1,478.90
合计	84,754.71

## 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	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
审计费用	49,588.57	
信息披露费	59,507.37	
证券出借违约金	-	
银行汇划费用	480.00	
合计	109,575.94	

## 6.4.7.24 分部报告

无。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

无。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 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	265,892.28	0.09	282,699,650.89	11.76
------	------------	------	----------------	-------

#### 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 2023年1月1日至2023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	244.99	0.09	244.99	0.12
关联方名称	上年度可比期间 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	263,281.36	12.43	253,678.24	14.36

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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,134,849.03	7,735,830.41
其中：支付销售机构的客户维护费	316,271.17	313,949.96

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.75%，逐日计提，按月支付。日管

理费=前一日基金资产净值×0.75%÷当年天数。

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,026,969.87	1,547,166.13

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)	鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)	合计
国信证券	-	87.15	87.15
鹏华基金公司	-	70,027.89	70,027.89
合计	-	70,115.04	70,115.04
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 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		
	鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)	鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)	合计
国信证券	-	3.95	3.95
鹏华基金公司	-	33,642.84	33,642.84
合计	-	33,646.79	33,646.79

注：鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF) 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF) 基金份额的销售服务费费率为 0.2%，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×0.2%÷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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借 业务余额	期末应收利息余额
国信证券	6,611,950.00	4,390.66	-	-
上年度可比期间 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
-	-	-	-	-

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	202304180005800	中信银行	2023 年 4 月 18 日	121,200.00	20,000	14	2.80	150.82	-	-

国信证券	2023041800006590	隆基绿能	2023年4月17日	792,400.00	20,000	2	3.20	140.87	-	-
国信证券	2023050400035203	中信银行	2023年5月4日	138,800.00	20,000	14	2.80	151.14	-	-
国信证券	2023051800021994	中信银行	2023年5月18日	141,400.00	20,000	14	2.80	153.97	-	-
国信证券	2023060100031961	中信银行	2023年6月1日	131,800.00	20,000	14	2.80	143.52	-	-
国信证券	2023061300012850	山西焦煤	2023年6月13日	268,320.00	26,000	14	3.10	323.47	-	-
国信证券	2023061500034095	中信银行	2023年6月15日	123,400.00	20,000	14	2.80	134.37	-	-
国信证券	2023062700017451	山西焦煤	2023年6月27日	234,000.00	26,000	14	3.10	60.45	236,600.00	60.45
国信证券	2023062900031437	中信银行	2023年6月29日	118,400.00	20,000	14	2.80	9.21	119,600.00	9.21
上年度可比期间 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-



#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	102,913,180.51	172,557.72	191,888,402.97	222,240.01

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023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：股/张）	总金额
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	2,618	104,144.04
国信证券	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40
国信证券	688562	航天软件	网下申购	7,254	91,980.72
上年度可比期间 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：股/张）	总金额
国信证券	-	-	-	-	-

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于2023年6月30日，本基金持有2,047,900.00股基金托管人中国工商银行发行的A股普通股，成本总额为人民币9,688,372.25元，估值总额为人民币9,870,878.00元，占基金资产净值的比例为0.75%；本基金持有171,700.00股国信证券发行的A股普通股，成本总额为人民币1,795,992.10元，估值总额为人民币1,498,941.00元，占基金资产净值的比例为0.11%。（于2022年6月30日，本基金持有3,977,300.00股基金托管人中国工商银行发行的A股普通股，成本总额为人民币18,883,755.33元，估值总额为人民币18,971,721.00元，占基金资产净值的比

例为 0.74%；本基金持有 327,600.00 股国信证券发行的 A 股普通股，成本总额为人民币 3,455,001.21 元，估值总额为人民币 3,135,132.00 元，占基金资产净值的比例为 0.12%。）

#### 6.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 6.4.12 期末（2023 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
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-

301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	44.18	25.10	338	10,647.38	8,483.80	科源制药于2023年5月26日每10股送4股
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股流通受限	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-

301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股流通受限	131.11	53.24	392	34,219.71	20,870.08	绿通科技于2023年5月25日每10股送5股
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	1,504	35,750.08	64,506.56	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-

301386	未来 电器	2023年 3月21 日	6个月	新股流 通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301399	英特 科技	2023年 5月16 日	6个月	新股流 通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人 健康	2023年 2月22 日	6个月	新股流 通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱 德	2023年 2月2 日	6个月	新股流 通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪 恒通	2023年 5月10 日	6个月	新股流 通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋 电力	2023年 3月10 日	6个月	新股流 通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚 科技	2023年 6月30 日	1个月 内(含)	新股未 上市	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚 科技	2023年 6月30 日	6个月	新股流 通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
301488	豪恩 汽电	2023年 6月26 日	1个月 内(含)	新股未 上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩 汽电	2023年 6月26 日	6个月	新股流 通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601061	中信 金属	2023年 3月30 日	6个月	新股流 通受限	6.58	7.58	3,947	25,971.26	29,918.26	-
601065	江盐 集团	2023年 3月31 日	6个月	新股流 通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚 股份	2023年 3月31 日	6个月	新股流 通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青 科技	2023年 3月30 日	6个月	新股流 通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重 科技	2023年 3月29	6个月	新股流 通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-

		日									
603137	恒尚节能	2023年 4月10日	6个月	新股流 通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51		-
603172	万丰股份	2023年 4月28日	6个月	新股流 通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86		-
688146	中船特气	2023年 4月13日	6个月	新股流 通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43		-
688249	晶合集成	2023年 4月24日	6个月	新股流 通受限	19.86	18.06	6,997	138,960.42	126,365.82		-
688334	西高院	2023年 6月9日	6个月	新股流 通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48		-
688352	颀中科技	2023年 4月11日	6个月	新股流 通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27		-
688361	中科飞测-U	2023年 5月12日	6个月	新股流 通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77		-
688429	时创能源	2023年 6月20日	6个月	新股流 通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38		-
688433	华曙高科	2023年 4月7日	6个月	新股流 通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00		-
688443	智翔金泰-U	2023年 6月13日	6个月	新股流 通受限	37.88	29.49	1,872	70,911.36	55,205.28		-
688458	美芯晟	2023年 5月15日	6个月	新股流 通受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96		-
688469	中芯集成-U	2023年 4月28日	6个月	新股流 通受限	5.69	5.41	13,027	74,123.63	70,476.07		-
688472	阿特斯	2023年 6月2日	6个月	新股流 通受限	11.10	17.04	4,814	53,435.40	82,030.56		-
688478	晶升股份	2023年 4月13日	6个月	新股流 通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74		-
688479	友车	2023年	6个月	新股流	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68		-

	科技	5月4日		通受限							
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42		索辰科技于2023年6月20日每10股送4.8股
688522	纳睿雷达	2023年2月22日	6个月	新股流通受限	46.68	51.50	4,299	200,677.32	221,398.50		-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20		-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股流通受限	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62		-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03		-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50		-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06		-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72		-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89		-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64		-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81		-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00		-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00		-

688620	安凯微	2023年 6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688629	华丰科技	2023年 6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年 6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

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	000002	万科 A	2023 年 7 月 10 日	14.02	67,000	939,340.00
2	000063	中兴通讯	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 14 日	45.54	89,900	4,094,046.00
3	000069	华侨城 A	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 11 日	4.40	115,000	506,000.00
4	000100	TCL 科技	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 12 日	3.94	297,000	1,170,180.00
5	000408	藏格矿业	2023 年 7 月 14 日	22.57	15,000	338,550.00
6	000538	云南白药	2023 年 7 月 4 日	52.48	1,200	62,976.00
7	000617	中油资本	2023 年 7 月 11 日	7.23	50,000	361,500.00
8	000625	长安汽车	2023 年 7 月 12 日-2023 年 7 月 14 日	12.93	141,000	1,823,130.00
9	000661	长春高新	2023 年 7 月 10 日	136.30	2,200	299,860.00
10	000725	京东方 A	2023 年 7 月 5 日	4.09	198,000	809,820.00
11	000792	盐湖股份	2023 年 7 月 5 日	19.17	59,600	1,142,532.00
12	000876	新希望	2023 年 7 月 14 日	11.68	40,000	467,200.00
13	000877	天山股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	8.14	40,500	329,670.00
14	000895	双汇发展	2023 年 7 月 10 日	24.49	12,200	298,778.00
15	000938	紫光股份	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 12 日	31.85	62,300	1,984,255.00
16	000963	华东医药	2023 年 7 月 13 日	43.37	2,000	86,740.00
17	000977	浪潮信息	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 12 日	48.50	23,000	1,115,500.00
18	000983	山西焦煤	2023 年 7 月 11 日	9.10	34,600	314,860.00
19	001289	龙源电力	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 14 日	22.50	3,400	76,500.00
20	001979	招商蛇口	2023 年 7 月 3 日-2023 年	13.03	88,200	1,149,246.00

		口	7月13日			.00
21	002001	新和成	2023年7月3日	15.40	6,700	103,180.00
22	002050	三花智控	2023年7月3日-2023年7月11日	30.26	56,700	1,715,742.00
23	002120	韵达股份	2023年7月5日-2023年7月11日	9.56	40,200	384,312.00
24	002129	TCL中环	2023年7月10日-2023年7月13日	33.20	59,600	1,978,720.00
25	002142	宁波银行	2023年7月3日	25.30	2,900	73,370.00
26	002180	纳思达	2023年7月10日	34.25	10,000	342,500.00
27	002202	金风科技	2023年7月13日	10.62	57,900	614,898.00
28	002230	科大讯飞	2023年7月5日-2023年7月13日	67.96	52,100	3,540,716.00
29	002236	大华股份	2023年7月3日-2023年7月13日	19.75	47,700	942,075.00
30	002241	歌尔股份	2023年7月3日-2023年7月13日	17.75	32,500	576,875.00
31	002271	东方雨虹	2023年7月4日	27.26	17,900	487,954.00
32	002352	顺丰控股	2023年7月14日	45.09	12,600	568,134.00
33	002371	北方华创	2023年7月3日	317.65	5,000	1,588,250.00
34	002459	晶澳科技	2023年7月4日-2023年7月14日	41.70	44,300	1,847,310.00
35	002460	赣锋锂业	2023年7月10日-2023年7月14日	60.96	32,000	1,950,720.00
36	002466	天齐锂业	2023年7月10日-2023年7月14日	69.91	28,200	1,971,462.00
37	002475	立讯精密	2023年7月11日	32.45	24,000	778,800.00
38	002555	三七互娱	2023年7月4日-2023年7月14日	34.88	42,300	1,475,424.00
39	002601	龙佰集团	2023年7月10日-2023年7月11日	16.50	39,200	646,800.00
40	002756	永兴材料	2023年7月3日-2023年7月12日	62.61	8,300	519,663.00
41	002812	恩捷股份	2023年7月5日-2023年7月13日	96.35	6,900	1,628,315.00
42	002821	凯莱英	2023年7月3日-2023年	117.86	6,400	754,304.00

			7月12日			0
43	002841	视源股份	2023年7月3日-2023年7月14日	66.84	10,800	721,872.00
44	002916	深南电路	2023年7月14日	75.37	1,000	75,370.00
45	002920	德赛西威	2023年7月4日-2023年7月12日	155.81	6,300	981,603.00
46	300014	亿纬锂能	2023年7月10日	60.50	25,000	1,512,500.00
47	300015	爱尔眼科	2023年7月5日	18.55	7,000	129,850.00
48	300033	同花顺	2023年7月12日-2023年7月13日	175.28	5,800	1,016,624.00
49	300207	欣旺达	2023年7月10日-2023年7月14日	16.32	16,000	261,120.00
50	300223	北京君正	2023年7月4日-2023年7月13日	88.31	5,500	485,705.00
51	300316	晶盛机电	2023年7月13日-2023年7月14日	70.90	14,700	1,042,230.00
52	300347	泰格医药	2023年7月12日	64.54	12,000	774,480.00
53	300413	芒果超媒	2023年7月12日-2023年7月13日	34.21	21,100	721,831.00
54	300454	深信服	2023年7月3日	113.25	4,100	464,325.00
55	300496	中科创达	2023年7月5日-2023年7月13日	96.35	8,400	809,340.00
56	300601	康泰生物	2023年7月14日	25.39	7,100	180,269.00
57	300628	亿联网络	2023年7月4日	35.07	4,500	157,815.00
58	300661	圣邦股份	2023年7月4日-2023年7月14日	82.13	8,400	689,892.00
59	300751	迈为股份	2023年7月14日	169.38	2,000	338,760.00
60	300759	康龙化成	2023年7月14日	38.28	9,200	352,176.00
61	300763	锦浪科技	2023年7月4日-2023年7月13日	104.10	5,500	572,550.00
62	300769	德方纳米	2023年7月4日-2023年7月14日	110.23	6,000	661,380.00
63	300896	爱美客	2023年7月10日	444.95	2,400	1,067,880.00
64	300919	中伟股	2023年7月12日-2023	60.25	7,000	421,750.00

		份	年 7 月 14 日			0
65	300957	贝泰妮	2023 年 7 月 12 日-2023 年 7 月 13 日	88.88	3,500	311,080.00
66	300979	华利集团	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 10 日	48.74	3,200	155,968.00
67	300999	金龙鱼	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 5 日	39.99	12,000	479,880.00
68	600025	华能水电	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 14 日	7.13	46,000	327,980.00
69	600029	南方航空	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	6.03	110,500	666,315.00
70	600031	三一重工	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	16.63	120,300	2,000,589.00
71	600039	四川路桥	2023 年 7 月 13 日-2023 年 7 月 14 日	9.81	57,300	562,113.00
72	600048	保利发展	2023 年 7 月 12 日-2023 年 7 月 13 日	13.03	154,400	2,011,832.00
73	600050	中国联通	2023 年 7 月 5 日	4.80	2,200	10,560.00
74	600104	上汽集团	2023 年 7 月 12 日	14.17	6,900	97,773.00
75	600111	北方稀土	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	23.98	46,100	1,105,478.00
76	600115	中国东航	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	4.76	181,900	865,844.00
77	600132	重庆啤酒	2023 年 7 月 14 日	92.16	3,100	285,696.00
78	600150	中国船舶	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 14 日	32.91	59,500	1,958,145.00
79	600176	中国巨石	2023 年 7 月 4 日	14.16	51,300	726,408.00
80	600183	生益科技	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 12 日	14.20	28,800	408,960.00
81	600188	兖矿能源	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 14 日	29.92	25,800	771,936.00
82	600219	南山铝业	2023 年 7 月 11 日	3.02	6,000	18,120.00
83	600276	恒瑞医药	2023 年 7 月 4 日	47.90	40,000	1,916,000.00
84	600346	恒力石化	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	14.33	40,700	583,231.00
85	600383	金地集团	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 10 日	7.21	71,400	514,794.00
86	600438	通威股	2023 年 7 月 4 日-2023 年	34.31	17,000	583,270.00

		份	7月14日			0
87	600460	士兰微	2023年7月10日-2023年7月13日	30.27	23,500	711,345.00
88	600547	山东黄金	2023年7月10日	23.48	36,000	845,280.00
89	600584	长电科技	2023年7月10日	31.17	28,000	872,760.00
90	600606	绿地控股	2023年7月5日-2023年7月14日	2.75	112,600	309,650.00
91	600660	福耀玻璃	2023年7月14日	35.85	7,900	283,215.00
92	600674	川投能源	2023年7月3日	15.05	4,200	63,210.00
93	600732	爱旭股份	2023年7月11日-2023年7月13日	30.75	22,000	676,500.00
94	600741	华域汽车	2023年7月4日	18.46	36,000	664,560.00
95	600745	闻泰科技	2023年7月14日	48.90	17,000	831,300.00
96	600803	新奥股份	2023年7月3日-2023年7月4日	18.98	26,100	495,378.00
97	600845	宝信软件	2023年7月4日	50.81	13,000	660,530.00
98	600875	东方电气	2023年7月14日	18.65	18,600	346,890.00
99	600884	杉杉股份	2023年7月3日-2023年7月4日	15.14	25,000	378,500.00
100	600919	江苏银行	2023年7月10日	7.35	20,000	147,000.00
101	601006	大秦铁路	2023年7月3日-2023年7月10日	7.43	149,500	1,110,785.00
102	601021	春秋航空	2023年7月13日	57.47	6,000	344,820.00
103	601088	中国神华	2023年7月13日	30.75	67,000	2,060,250.00
104	601100	恒立液压	2023年7月12日-2023年7月13日	64.33	14,700	945,651.00
105	601111	中国国航	2023年7月3日-2023年7月13日	8.24	94,800	781,152.00
106	601138	工业富联	2023年7月4日-2023年7月14日	25.20	112,200	2,827,440.00
107	601155	新城控股	2023年7月3日-2023年7月12日	14.41	25,600	368,896.00
108	601216	君正集	2023年7月4日-2023年	4.10	91,000	373,100.00

		团	7月13日			0
109	601225	陕西煤业	2023年7月13日	18.19	27,000	491,130.00
110	601236	红塔证券	2023年7月3日-2023年7月13日	7.45	25,200	187,740.00
111	601336	新华保险	2023年7月10日	36.77	19,000	698,630.00
112	601360	三六零	2023年7月4日-2023年7月14日	12.54	97,000	1,216,380.00
113	601390	中国中铁	2023年7月5日-2023年7月13日	7.58	233,500	1,769,930.00
114	601615	明阳智能	2023年7月4日-2023年7月14日	16.88	35,700	602,616.00
115	601628	中国人寿	2023年7月14日	34.96	1,700	59,432.00
116	601633	长城汽车	2023年7月11日-2023年7月14日	25.17	11,100	279,387.00
117	601658	邮储银行	2023年7月3日-2023年7月10日	4.89	240,600	1,176,534.00
118	601669	中国电建	2023年7月4日-2023年7月14日	5.74	195,900	1,124,466.00
119	601689	拓普集团	2023年7月10日-2023年7月12日	80.70	12,300	992,610.00
120	601698	中国卫通	2023年7月10日-2023年7月14日	19.88	11,800	234,584.00
121	601728	中国电信	2023年7月13日	5.63	218,900	1,232,407.00
122	601766	中国中车	2023年7月12日	6.50	64,000	416,000.00
123	601788	光大证券	2023年7月3日-2023年7月4日	15.89	31,600	502,124.00
124	601799	星宇股份	2023年7月3日	123.60	3,000	370,800.00
125	601800	中国交建	2023年7月14日	10.91	46,800	510,588.00
126	601816	京沪高铁	2023年7月12日	5.26	13,400	70,484.00
127	601865	福莱特	2023年7月3日-2023年7月14日	38.51	13,100	504,481.00
128	601868	中国能建	2023年7月4日-2023年7月14日	2.34	307,500	719,550.00
129	601872	招商轮船	2023年7月14日	5.79	65,400	378,666.00
130	601919	中远海	2023年7月3日-2023年	9.40	182,200	1,712,680

		控	7月14日			.00
131	601988	中国银行	2023年7月4日-2023年7月11日	3.91	140,200	548,182.00
132	601995	中金公司	2023年7月4日-2023年7月13日	35.52	25,000	888,000.00
133	601998	中信银行	2023年7月3日-2023年7月13日	5.98	68,000	406,640.00
134	603019	中科曙光	2023年7月10日-2023年7月12日	50.90	32,800	1,669,520.00
135	603185	弘元绿能	2023年7月10日-2023年7月14日	74.55	5,500	410,025.00
136	603195	公牛集团	2023年7月3日-2023年7月10日	96.06	2,800	268,968.00
137	603260	合盛硅业	2023年7月5日-2023年7月10日	70.02	7,000	490,140.00
138	603288	海天味业	2023年7月13日-2023年7月14日	46.85	42,000	1,967,700.00
139	603290	斯达半导	2023年7月4日	215.20	1,300	279,760.00
140	603392	万泰生物	2023年7月4日-2023年7月5日	66.77	5,800	387,266.00
141	603486	科沃斯	2023年7月10日-2023年7月12日	77.77	6,100	474,397.00
142	603659	璞泰来	2023年7月4日-2023年7月14日	38.22	28,300	1,081,626.00
143	603799	华友钴业	2023年7月4日-2023年7月14日	45.91	36,400	1,671,124.00
144	603806	福斯特	2023年7月3日-2023年7月14日	37.19	20,600	766,114.00
145	603833	欧派家居	2023年7月12日-2023年7月13日	95.80	4,800	459,840.00
146	603899	晨光股份	2023年7月12日	44.64	7,000	312,480.00
147	603993	洛阳钼业	2023年7月11日-2023年7月14日	5.33	54,300	289,419.00
148	605117	德业股份	2023年7月3日-2023年7月13日	149.55	4,900	732,795.00
149	688005	容百科技	2023年7月11日-2023年7月12日	54.02	8,400	453,768.00
150	688008	澜起科技	2023年7月3日-2023年7月13日	57.42	22,400	1,286,208.00
151	688036	传音控股	2023年7月3日-2023年7月13日	147.00	9,000	1,323,000.00
152	688065	凯赛生	2023年7月10日-2023	62.26	5,000	311,300.00

		物	年 7 月 14 日			0
153	688111	金山办公	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 13 日	472.22	5,200	2,455,544.00
154	688223	晶科能源	2023 年 7 月 10 日	14.06	40,000	562,400.00
155	688303	大全能源	2023 年 7 月 4 日	40.45	5,000	202,250.00
156	688363	华熙生物	2023 年 7 月 5 日	89.16	1,500	133,740.00
157	688561	奇安信-U	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	51.81	7,600	393,756.00
158	688599	天合光能	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	42.61	30,300	1,291,083.00
合计	-	-	-	-	6,687,800	124,527,977.00

#### 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

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

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

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

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



#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2022 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 2023 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（净资产）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 2023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	102,913,180.51	-	-	-	102,913,180.51
结算备付金	35,754.34	-	-	-	35,754.34
存出保证金	73,883.20	-	-	-	73,883.20
交易性金融资产	-	-	-	1,220,783,840.77	1,220,783,840.77
应收股利	-	-	-	140,433.87	140,433.87
应收申购款	-	-	-	237,917.39	237,917.39
应收清算款	-	-	-	1,188.19	1,188.19
其他资产	-	-	-	45,944.46	45,944.46
资产总计	103,022,818.05	-	-	1,221,209,324.68	1,324,232,142.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	991,435.58	991,435.58
应付管理人报酬	-	-	-	812,832.14	812,832.14
应付托管费	-	-	-	162,566.45	162,566.45
应付清算款	-	-	-	79.20	79.20
应付销售服务费	-	-	-	16,296.10	16,296.10
应交税费	-	-	-	10,211.50	10,211.50
其他负债	-	-	-	314,678.47	314,678.47
负债总计	-	-	-	2,308,099.44	2,308,099.44

利率敏感度缺口	103,022,818.05	-	-	-1,218,901,225.24	1,321,924,043.29
上年度末 2022 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	115,588,055.13	-	-	-	115,588,055.13
结算备付金	35,433.06	-	-	-	35,433.06
存出保证金	211,820.49	-	-	-	211,820.49
交易性金融资产	-	-	-	-1,256,869,577.50	1,256,869,577.50
应收申购款	-	-	-	246,066.21	246,066.21
应收清算款	-	-	-	178,112.49	178,112.49
其他资产	-	-	-	35,893.59	35,893.59
资产总计	115,835,308.68	-	-	-1,257,329,649.79	1,373,164,958.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	19,783,967.95	19,783,967.95
应付管理人报酬	-	-	-	920,605.37	920,605.37
应付托管费	-	-	-	184,121.08	184,121.08
应付销售服务费	-	-	-	18,922.32	18,922.32
应交税费	-	-	-	6,211.77	6,211.77
其他负债	-	-	-	940,543.60	940,543.60
负债总计	-	-	-	21,854,372.09	21,854,372.09
利率敏感度缺口	115,835,308.68	-	-	-1,235,475,277.70	1,351,310,586.38

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 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%。因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

面临的其他价格风险来源于标的指数成份券和备选成份券证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	1,220,783,840.77	92.35	1,256,869,577.50	93.01
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	1,220,783,840.77	92.35	1,256,869,577.50	93.01

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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)

	动	本期末 (2023 年 6 月 30 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
分析	业绩比较基准上升 5%	61,165,425.48	62,849,455.37
	业绩比较基准下降 5%	-61,165,425.48	-62,849,455.37

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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	1,218,406,855.55
第二层次	726,804.90
第三层次	1,650,180.32
合计	1,220,783,840.77

###### 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	1,220,783,840.77	92.19
	其中：股票	1,220,783,840.77	92.19
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	102,948,934.85	7.77
8	其他各项资产	499,367.11	0.04
9	合计	1,324,232,142.73	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 123,564,477.00 元，占基金资产净值比为 9.35%。

### 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	12,291,269.70	0.93
B	采矿业	47,497,528.56	3.59

C	制造业	696,679,326.14	52.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,834,577.49	2.64
E	建筑业	29,837,763.76	2.26
F	批发和零售业	3,751,746.38	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	39,522,426.28	2.99
H	住宿和餐饮业	1,117,776.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,303,032.74	5.02
J	金融业	233,583,413.08	17.67
K	房地产业	20,081,286.01	1.52
L	租赁和商务服务业	10,333,874.42	0.78
M	科学研究和技术服务业	11,543,703.35	0.87
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	8,284,711.35	0.63
R	文化、体育和娱乐业	2,062,863.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	1,217,725,298.26	92.12

### 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	2,748,365.11	0.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	83,405.23	0.01
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	119,783.56	0.01
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	37,242.13	0.00
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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,058,542.51	0.23

### 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	36,647	61,970,077.00	4.69
2	300750	宁德时代	154,059	35,247,158.61	2.67
3	601318	中国平安	632,685	29,356,584.00	2.22
4	600036	招商银行	723,155	23,690,557.80	1.79
5	000858	五粮液	113,497	18,564,704.29	1.40
6	000333	美的集团	287,136	16,918,053.12	1.28
7	600276	恒瑞医药	314,098	15,045,294.20	1.14
8	002594	比亚迪	52,973	13,681,336.71	1.03
9	002475	立讯精密	411,309	13,346,977.05	1.01
10	601166	兴业银行	850,052	13,303,313.80	1.01
11	600900	长江电力	571,730	12,612,363.80	0.95
12	000063	中兴通讯	258,700	11,781,198.00	0.89
13	600030	中信证券	571,936	11,312,894.08	0.86
14	601899	紫金矿业	962,606	10,944,830.22	0.83
15	600887	伊利股份	372,087	10,537,503.84	0.80
16	300059	东方财富	741,295	10,526,389.00	0.80
17	002230	科大讯飞	150,678	10,240,076.88	0.77
18	601012	隆基绿能	354,039	10,150,298.13	0.77
19	601398	工商银行	2,047,900	9,870,878.00	0.75
20	000725	京东方 A	2,387,705	9,765,713.45	0.74
21	600309	万华化学	110,097	9,670,920.48	0.73
22	000651	格力电器	263,179	9,608,665.29	0.73

23	601328	交通银行	1,601,600	9,289,280.00	0.70
24	002415	海康威视	273,086	9,041,877.46	0.68
25	000568	泸州老窖	43,040	9,019,892.80	0.68
26	002129	TCL 中环	263,125	8,735,750.00	0.66
27	300760	迈瑞医疗	28,300	8,484,340.00	0.64
28	601138	工业富联	322,900	8,137,080.00	0.62
29	600438	通威股份	220,000	7,548,200.00	0.57
30	601816	京沪高铁	1,434,300	7,544,418.00	0.57
31	600028	中国石化	1,181,295	7,513,036.20	0.57
32	603259	药明康德	119,985	7,476,265.35	0.57
33	300274	阳光电源	62,700	7,312,701.00	0.55
34	000792	盐湖股份	377,500	7,236,675.00	0.55
35	600031	三一重工	434,607	7,227,514.41	0.55
36	601668	中国建筑	1,227,147	7,043,823.78	0.53
37	300015	爱尔眼科	379,257	7,035,217.35	0.53
38	688111	金山办公	14,826	7,001,133.72	0.53
39	300124	汇川技术	108,135	6,943,348.35	0.53
40	002714	牧原股份	159,958	6,742,229.70	0.51
41	000002	万科 A	476,832	6,685,184.64	0.51
42	600919	江苏银行	905,100	6,652,485.00	0.50
43	601288	农业银行	1,864,443	6,581,483.79	0.50
44	002352	顺丰控股	145,700	6,569,613.00	0.50
45	002371	北方华创	20,400	6,480,060.00	0.49
46	601766	中国中车	987,576	6,419,244.00	0.49
47	000001	平安银行	568,310	6,382,121.30	0.48
48	601728	中国电信	1,128,011	6,350,701.93	0.48
49	601390	中国中铁	837,147	6,345,574.26	0.48
50	601888	中国中免	57,134	6,315,021.02	0.48
51	603288	海天味业	128,694	6,029,313.90	0.46
52	601088	中国神华	193,192	5,940,654.00	0.45
53	002142	宁波银行	234,584	5,934,975.20	0.45
54	600048	保利发展	443,081	5,773,345.43	0.44
55	601225	陕西煤业	316,949	5,765,302.31	0.44
56	688981	中芯国际	114,109	5,764,786.68	0.44
57	002466	天齐锂业	81,900	5,725,629.00	0.43
58	000938	紫光股份	178,059	5,671,179.15	0.43
59	600150	中国船舶	171,400	5,640,774.00	0.43
60	002460	赣锋锂业	92,140	5,616,854.40	0.42
61	600905	三峡能源	1,040,300	5,586,411.00	0.42
62	300498	温氏股份	302,400	5,549,040.00	0.42
63	600016	民生银行	1,451,034	5,441,377.50	0.41
64	600690	海尔智家	231,646	5,439,048.08	0.41
65	600406	国电南瑞	234,347	5,413,415.70	0.41

66	601988	中国银行	1,379,508	5,393,876.28	0.41
67	600050	中国联通	1,118,002	5,366,409.60	0.41
68	002459	晶澳科技	126,616	5,279,887.20	0.40
69	600809	山西汾酒	28,520	5,278,196.40	0.40
70	000625	长安汽车	404,892	5,235,253.56	0.40
71	600837	海通证券	566,813	5,226,015.86	0.40
72	601601	中国太保	199,879	5,192,856.42	0.39
73	600089	特变电工	226,700	5,053,143.00	0.38
74	600436	片仔癀	17,600	5,039,936.00	0.38
75	600000	浦发银行	693,000	5,017,320.00	0.38
76	601857	中国石油	661,673	4,942,697.31	0.37
77	002050	三花智控	162,217	4,908,686.42	0.37
78	600941	中国移动	52,500	4,898,250.00	0.37
79	601919	中远海控	519,640	4,884,616.00	0.37
80	000100	TCL 科技	1,226,196	4,831,212.24	0.37
81	603799	华友钴业	104,281	4,787,540.71	0.36
82	603019	中科曙光	93,920	4,780,528.00	0.36
83	600111	北方稀土	197,903	4,745,713.94	0.36
84	603501	韦尔股份	48,405	4,745,626.20	0.36
85	601628	中国人寿	135,049	4,721,313.04	0.36
86	600660	福耀玻璃	130,025	4,661,396.25	0.35
87	002304	洋河股份	35,250	4,630,087.50	0.35
88	002271	东方雨虹	163,400	4,454,284.00	0.34
89	601658	邮储银行	888,800	4,346,232.00	0.33
90	300014	亿纬锂能	71,800	4,343,900.00	0.33
91	002555	三七互娱	120,600	4,206,528.00	0.32
92	601688	华泰证券	303,515	4,179,401.55	0.32
93	002812	恩捷股份	43,200	4,162,320.00	0.31
94	603986	兆易创新	38,684	4,110,175.00	0.31
95	002027	分众传媒	590,140	4,018,853.40	0.30
96	600104	上汽集团	283,507	4,017,294.19	0.30
97	601169	北京银行	860,017	3,981,878.71	0.30
98	000338	潍柴动力	316,792	3,947,228.32	0.30
99	688012	中微公司	25,130	3,931,588.50	0.30
100	600570	恒生电子	88,408	3,915,590.32	0.30
101	601985	中国核电	552,400	3,894,420.00	0.29
102	300896	爱美客	8,700	3,871,065.00	0.29
103	688036	传音控股	25,758	3,786,426.00	0.29
104	601211	国泰君安	267,500	3,742,325.00	0.28
105	688599	天合光能	87,787	3,740,604.07	0.28
106	300316	晶盛机电	52,700	3,736,430.00	0.28
107	002049	紫光国微	39,480	3,681,510.00	0.28
108	688008	澜起科技	64,057	3,678,152.94	0.28

109	601006	大秦铁路	486,131	3,611,953.33	0.27
110	300122	智飞生物	80,850	3,573,570.00	0.27
111	000661	长春高新	26,200	3,571,060.00	0.27
112	601360	三六零	277,877	3,484,577.58	0.26
113	002241	歌尔股份	194,336	3,449,464.00	0.26
114	600584	长电科技	110,100	3,431,817.00	0.26
115	600547	山东黄金	146,024	3,428,643.52	0.26
116	300142	沃森生物	129,100	3,414,695.00	0.26
117	600588	用友网络	165,345	3,389,572.50	0.26
118	600585	海螺水泥	142,031	3,371,815.94	0.26
119	601818	光大银行	1,091,224	3,350,057.68	0.25
120	002179	中航光电	73,710	3,342,748.50	0.25
121	601229	上海银行	579,958	3,334,758.50	0.25
122	600009	上海机场	72,647	3,299,626.74	0.25
123	001979	招商蛇口	252,245	3,286,752.35	0.25
124	600893	航发动力	77,500	3,275,150.00	0.25
125	000977	浪潮信息	66,900	3,244,650.00	0.25
126	601669	中国电建	560,453	3,217,000.22	0.24
127	601989	中国重工	659,300	3,177,826.00	0.24
128	603659	璞泰来	81,375	3,110,152.50	0.24
129	603993	洛阳钼业	576,900	3,074,877.00	0.23
130	300033	同花顺	17,300	3,032,344.00	0.23
131	600999	招商证券	220,874	2,997,260.18	0.23
132	600958	东方证券	304,836	2,956,909.20	0.22
133	600019	宝钢股份	524,855	2,949,685.10	0.22
134	600845	宝信软件	57,132	2,902,876.92	0.22
135	600760	中航沈飞	64,204	2,889,180.00	0.22
136	601689	拓普集团	35,500	2,864,850.00	0.22
137	002920	德赛西威	18,100	2,820,161.00	0.21
138	002709	天赐材料	67,300	2,772,087.00	0.21
139	601100	恒立液压	42,836	2,755,639.88	0.21
140	300347	泰格医药	42,500	2,742,950.00	0.21
141	002410	广联达	83,980	2,728,510.20	0.21
142	002236	大华股份	137,525	2,716,118.75	0.21
143	601600	中国铝业	493,917	2,711,604.33	0.21
144	601186	中国铁建	268,893	2,648,596.05	0.20
145	600426	华鲁恒升	86,200	2,640,306.00	0.20
146	002252	上海莱士	348,400	2,616,484.00	0.20
147	600029	南方航空	428,554	2,584,180.62	0.20
148	000776	广发证券	173,840	2,557,186.40	0.19
149	601995	中金公司	71,600	2,543,232.00	0.19
150	601633	长城汽车	100,527	2,530,264.59	0.19
151	300450	先导智能	69,000	2,495,730.00	0.19

152	601336	新华保险	67,700	2,489,329.00	0.19
153	300496	中科创达	25,800	2,485,830.00	0.19
154	600346	恒力石化	173,460	2,485,681.80	0.19
155	600115	中国东航	521,083	2,480,355.08	0.19
156	600745	闻泰科技	50,500	2,469,450.00	0.19
157	000166	申万宏源	530,600	2,451,372.00	0.19
158	601377	兴业证券	397,453	2,432,412.36	0.18
159	601939	建设银行	388,353	2,431,089.78	0.18
160	601009	南京银行	301,411	2,411,288.00	0.18
161	600011	华能国际	256,000	2,370,560.00	0.18
162	600010	包钢股份	1,324,114	2,370,164.06	0.18
163	000596	古井贡酒	9,500	2,350,110.00	0.18
164	600741	华域汽车	126,212	2,329,873.52	0.18
165	000963	华东医药	53,074	2,301,819.38	0.17
166	600196	复星医药	74,191	2,292,501.90	0.17
167	600085	同仁堂	39,819	2,291,981.64	0.17
168	000538	云南白药	43,371	2,276,110.08	0.17
169	002202	金风科技	213,856	2,271,150.72	0.17
170	300408	三环集团	77,200	2,265,820.00	0.17
171	601800	中国交建	207,630	2,265,243.30	0.17
172	002311	海大集团	48,300	2,262,372.00	0.17
173	000301	东方盛虹	190,300	2,249,346.00	0.17
174	601111	中国国航	271,851	2,240,052.24	0.17
175	600188	兖矿能源	73,400	2,196,128.00	0.17
176	603806	福斯特	58,944	2,192,127.36	0.17
177	600886	国投电力	172,940	2,187,691.00	0.17
178	002821	凯莱英	18,360	2,163,909.60	0.16
179	002841	视源股份	32,100	2,145,564.00	0.16
180	600600	青岛啤酒	20,700	2,145,141.00	0.16
181	601615	明阳智能	126,900	2,142,072.00	0.16
182	000768	中航西飞	79,859	2,136,228.25	0.16
183	300454	深信服	18,600	2,106,450.00	0.16
184	300782	卓胜微	21,700	2,096,871.00	0.16
185	600176	中国巨石	146,694	2,077,187.04	0.16
186	002493	荣盛石化	178,350	2,075,994.00	0.16
187	605117	德业股份	13,860	2,072,763.00	0.16
188	300413	芒果超媒	60,300	2,062,863.00	0.16
189	601868	中国能建	880,600	2,060,604.00	0.16
190	600460	士兰微	67,300	2,037,171.00	0.15
191	600674	川投能源	134,200	2,019,710.00	0.15
192	600926	杭州银行	171,560	2,015,830.00	0.15
193	000733	振华科技	20,800	1,993,680.00	0.15
194	600015	华夏银行	367,697	1,989,240.77	0.15

195	000876	新希望	169,400	1,978,592.00	0.15
196	300661	圣邦股份	24,050	1,975,226.50	0.15
197	300999	金龙鱼	49,200	1,967,508.00	0.15
198	600039	四川路桥	199,640	1,958,468.40	0.15
199	600795	国电电力	510,743	1,956,145.69	0.15
200	002180	纳思达	57,000	1,952,250.00	0.15
201	600732	爱旭股份	63,420	1,950,165.00	0.15
202	300769	德方纳米	17,340	1,911,388.20	0.14
203	000157	中联重科	283,138	1,911,181.50	0.14
204	603369	今世缘	35,900	1,895,520.00	0.14
205	603392	万泰生物	28,090	1,875,569.30	0.14
206	601066	中信建投	77,400	1,873,080.00	0.14
207	000425	徐工机械	273,240	1,849,834.80	0.14
208	002601	龙佰集团	112,100	1,849,650.00	0.14
209	600383	金地集团	254,319	1,833,639.99	0.14
210	601788	光大证券	112,900	1,793,981.00	0.14
211	601021	春秋航空	31,200	1,793,064.00	0.14
212	002001	新和成	114,172	1,758,248.80	0.13
213	601117	中国化学	212,100	1,756,188.00	0.13
214	688303	大全能源	43,400	1,755,530.00	0.13
215	601877	正泰电器	62,400	1,725,360.00	0.13
216	000895	双汇发展	70,168	1,718,414.32	0.13
217	002074	国轩高科	61,800	1,706,916.00	0.13
218	300223	北京君正	19,300	1,704,383.00	0.13
219	601618	中国中冶	415,600	1,649,932.00	0.12
220	688126	沪硅产业	78,776	1,646,418.40	0.12
221	688223	晶科能源	116,800	1,642,208.00	0.12
222	300763	锦浪科技	15,700	1,634,370.00	0.12
223	600989	宝丰能源	129,100	1,627,951.00	0.12
224	688396	华润微	30,370	1,591,691.70	0.12
225	601838	成都银行	127,300	1,554,333.00	0.12
226	601865	福莱特	40,000	1,540,400.00	0.12
227	601901	方正证券	233,538	1,527,338.52	0.12
228	002756	永兴材料	23,950	1,499,509.50	0.11
229	002736	国信证券	171,700	1,498,941.00	0.11
230	002648	卫星化学	97,780	1,462,788.80	0.11
231	603260	合盛硅业	20,800	1,456,416.00	0.11
232	003816	中国广核	468,200	1,456,102.00	0.11
233	000069	华侨城 A	330,299	1,453,315.60	0.11
234	601607	上海医药	64,700	1,449,927.00	0.11
235	600233	圆通速递	99,200	1,444,352.00	0.11
236	300207	欣旺达	88,100	1,437,792.00	0.11
237	600803	新奥股份	75,200	1,427,296.00	0.11

238	000786	北新建材	58,100	1,424,031.00	0.11
239	002007	华兰生物	62,773	1,406,742.93	0.11
240	601799	星宇股份	11,100	1,371,960.00	0.10
241	603486	科沃斯	17,600	1,368,752.00	0.10
242	300628	亿联网络	38,740	1,358,611.80	0.10
243	300433	蓝思科技	114,799	1,350,036.24	0.10
244	601238	广汽集团	129,200	1,346,264.00	0.10
245	600884	杉杉股份	88,700	1,342,918.00	0.10
246	300751	迈为股份	7,900	1,338,102.00	0.10
247	603833	欧派家居	13,940	1,335,452.00	0.10
248	300759	康龙化成	34,600	1,324,488.00	0.10
249	603290	斯达半导	6,100	1,312,720.00	0.10
250	688005	容百科技	24,043	1,298,802.86	0.10
251	600332	白云山	39,935	1,273,127.80	0.10
252	600132	重庆啤酒	13,800	1,271,808.00	0.10
253	600183	生益科技	89,100	1,265,220.00	0.10
254	600763	通策医疗	12,900	1,249,494.00	0.09
255	601881	中国银河	104,800	1,216,728.00	0.09
256	300919	中伟股份	20,100	1,211,025.00	0.09
257	603185	弘元绿能	16,200	1,207,710.00	0.09
258	600219	南山铝业	397,300	1,199,846.00	0.09
259	000983	山西焦煤	131,200	1,193,920.00	0.09
260	600875	东方电气	63,800	1,189,870.00	0.09
261	601998	中信银行	196,651	1,175,972.98	0.09
262	002916	深南电路	15,460	1,165,220.20	0.09
263	300601	康泰生物	45,200	1,147,628.00	0.09
264	688363	华熙生物	12,685	1,130,994.60	0.09
265	688561	奇安信-U	21,719	1,125,261.39	0.09
266	600362	江西铜业	59,077	1,121,281.46	0.08
267	000723	美锦能源	148,600	1,120,444.00	0.08
268	601699	潞安环能	68,600	1,119,552.00	0.08
269	600754	锦江酒店	26,400	1,117,776.00	0.08
270	601319	中国人保	188,200	1,099,088.00	0.08
271	002120	韵达股份	114,917	1,098,606.52	0.08
272	601872	招商轮船	188,200	1,089,678.00	0.08
273	600918	中泰证券	157,000	1,084,870.00	0.08
274	601216	君正集团	261,626	1,072,666.60	0.08
275	000617	中油资本	146,200	1,057,026.00	0.08
276	601155	新城控股	72,800	1,049,048.00	0.08
277	600025	华能水电	145,600	1,038,128.00	0.08
278	601878	浙商证券	103,300	1,020,604.00	0.08
279	000408	藏格矿业	44,700	1,008,879.00	0.08
280	600061	国投资本	141,624	1,008,362.88	0.08

281	002938	鹏鼎控股	40,100	974,029.00	0.07
282	000708	中信特钢	59,800	947,232.00	0.07
283	000877	天山股份	115,500	940,170.00	0.07
284	603899	晨光股份	20,598	919,494.72	0.07
285	601898	中煤能源	108,000	911,520.00	0.07
286	600606	绿地控股	324,485	892,333.75	0.07
287	600018	上港集团	167,983	881,910.75	0.07
288	300957	贝泰妮	9,800	871,024.00	0.07
289	688065	凯赛生物	13,782	858,067.32	0.06
290	603195	公牛集团	8,004	768,864.24	0.06
291	002064	华峰化学	111,500	764,890.00	0.06
292	002414	高德红外	93,095	723,348.15	0.05
293	601698	中国卫通	34,600	687,848.00	0.05
294	688187	时代电气	15,000	627,900.00	0.05
295	300979	华利集团	11,900	580,006.00	0.04
296	601236	红塔证券	72,110	537,219.50	0.04
297	000800	一汽解放	58,300	487,971.00	0.04
298	601808	中海油服	33,600	466,368.00	0.04
299	605499	东鹏饮料	2,500	432,250.00	0.03
300	001289	龙源电力	12,700	285,750.00	0.02

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.03
2	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.02
3	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.02
4	688522	纳睿雷达	4,299	221,398.50	0.02
5	688249	晶合集成	6,997	126,365.82	0.01
6	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
7	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
8	688472	阿特斯	4,814	82,030.56	0.01
9	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
10	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
11	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
12	688469	中芯集成-U	13,027	70,476.07	0.01
13	301358	湖南裕能	1,504	64,506.56	0.00
14	688443	智翔金泰-U	1,872	55,205.28	0.00
15	688361	中科飞测-U	831	53,740.77	0.00
16	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
17	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
18	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
19	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
20	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00



21	601061	中信金属	3,947	29,918.26	0.00
22	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
23	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
24	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
25	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
26	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
27	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
28	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
29	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
30	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
31	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
32	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
33	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
34	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
35	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
36	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
37	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
38	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
39	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
40	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
41	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
42	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
43	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
44	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
45	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
46	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
47	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
48	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
49	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
50	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
51	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
52	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
53	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
54	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
55	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
56	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
57	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
58	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
59	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
60	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
61	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
62	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
63	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00

64	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
65	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
66	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
67	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
68	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
69	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
70	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
71	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
72	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
73	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
74	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
75	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
76	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
77	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
78	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
79	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	600905	三峡能源	2,607,960.00	0.19
2	002475	立讯精密	2,469,218.00	0.18
3	600028	中国石化	2,066,327.00	0.15
4	002230	科大讯飞	2,000,849.00	0.15
5	000063	中兴通讯	1,847,753.00	0.14
6	600732	爱旭股份	1,737,002.00	0.13
7	600941	中国移动	1,736,269.00	0.13
8	002129	TCL 中环	1,606,822.00	0.12
9	000938	紫光股份	1,587,589.00	0.12
10	002459	晶澳科技	1,565,138.00	0.12
11	300015	爱尔眼科	1,549,219.13	0.11
12	600150	中国船舶	1,546,116.00	0.11
13	601360	三六零	1,503,149.00	0.11
14	688223	晶科能源	1,478,723.97	0.11
15	600438	通威股份	1,477,930.00	0.11
16	601607	上海医药	1,415,852.00	0.10
17	688249	晶合集成	1,389,584.34	0.10
18	600111	北方稀土	1,362,257.00	0.10
19	000983	山西焦煤	1,347,410.00	0.10
20	688111	金山办公	1,339,431.98	0.10

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	600519	贵州茅台	10,937,568.00	0.81
2	300750	宁德时代	5,600,635.00	0.41
3	601318	中国平安	5,332,800.00	0.39
4	600900	长江电力	4,622,518.00	0.34
5	600036	招商银行	4,243,867.00	0.31
6	000858	五粮液	3,396,366.00	0.25
7	000333	美的集团	2,735,922.00	0.20
8	002602	世纪华通	2,521,700.06	0.19
9	601166	兴业银行	2,500,248.00	0.19
10	002594	比亚迪	2,383,828.00	0.18
11	600887	伊利股份	1,980,055.00	0.15
12	600030	中信证券	1,974,790.00	0.15
13	601012	隆基绿能	1,918,546.00	0.14
14	300059	东方财富	1,906,188.00	0.14
15	600309	万华化学	1,718,131.04	0.13
16	601398	工商银行	1,710,917.00	0.13
17	000651	格力电器	1,663,292.00	0.12
18	002415	海康威视	1,648,131.00	0.12
19	000568	泸州老窖	1,629,307.00	0.12
20	601328	交通银行	1,598,281.00	0.12

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	133,312,810.24
卖出股票收入（成交）总额	168,351,764.18

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。

**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**

中国平安保险(集团)股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚。

招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会的处罚。

兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

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	73,883.20
2	应收清算款	1,188.19
3	应收股利	140,433.87
4	应收利息	-
5	应收申购款	237,917.39
6	其他应收款	45,944.46

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	499,367.11

#### 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	600276	恒瑞医药	1,916,000.00	0.14	转融通流通受限
2	002475	立讯精密	778,800.00	0.06	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	301486	致尚科技	250,129.08	0.02	新股未上市
1	301486	致尚科技	27,792.12	0.00	新股流通受限
2	688522	纳睿雷达	221,398.50	0.02	新股流通受限
3	688249	晶合集成	126,365.82	0.01	新股流通受限
4	301291	明阳电气	37,422.18	0.00	新股流通受限
5	688582	芯动联科	26,360.64	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 (%)
鹏华沪深	23,688	41,183.19	773,545,095.63	79.29	202,002,300.40	20.71

300 指数 A 类 (LOF)						
鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)	3,694	25,299.25	60,054,801.24	64.26	33,400,610.44	35.74
合计	27,382	39,040.35	833,599,896.87	77.98	235,402,910.84	22.02

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

### 鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	宁波航发贸易有限公司	869,380.00	13.61
2	欧静虹	208,300.00	3.26
3	曾小惠	200,000.00	3.13
4	李宏英	198,013.00	3.10
5	江苏大千投资发展有限公司	164,420.00	2.57
6	邱贤奕	117,300.00	1.84
7	朱洪宏	116,200.00	1.82
8	屈丹耘	110,008.00	1.72
9	洪恒敏	101,916.00	1.60
10	彭世华	100,000.00	1.57
10	袁忠东	100,000.00	1.57

注：持有人为场内持有人。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)	42,951.77	0.0044
	鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)	34,015.88	0.0364
	合计	76,967.65	0.0072

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

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)	鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)
基金合同生效日 (2009 年 4 月 3 日) 基金份额总额	1,994,428,997.48	-
本报告期期初基金份额总额	994,616,080.28	105,820,037.38
本报告期基金总申购份额	42,067,773.72	42,723,681.76
减: 本报告期基金总赎回份额	61,136,457.97	55,088,307.46
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	975,547,396.03	93,455,411.68

## § 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

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

本基金本报告期投资策略未改变。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注: 无。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注: 本报告期内, 本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中泰证券	1	137,543,057.03	47.98	126,710.43	48.58	-
兴业证券	1	77,999,233.58	27.21	71,861.05	27.55	-
中金公司	1	38,172,026.21	13.32	35,168.13	13.48	-
国元证券	1	21,103,355.79	7.36	17,332.46	6.64	-
华西证券	1	10,675,823.61	3.72	8,768.12	3.36	-
国盛证券	1	678,200.06	0.24	556.97	0.21	-
国信证券	2	265,892.28	0.09	244.99	0.09	-
国泰君安	1	211,557.03	0.07	194.93	0.07	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

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

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨



询服务。

2) 选择交易单元的程序:

我公司根据上述标准, 选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比, 评比内容包括: 提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况, 并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后, 向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

招商证 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澄清公告	《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	2023 年 01 月 04 日
2	关于调整旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司申购、定期定额申购费率优惠活动时间的公告	《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	2023 年 01 月 05 日
3	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2022 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	2023 年 01 月 20 日
4	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购中润光学首次公开发行 A 股的公告	《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	2023 年 02 月 10 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东方财富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	2023 年 03 月 14 日
6	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2022 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	2023 年 03 月 30 日
7	鹏华基金管理有限公司关于新增人民币直销资金专户的公告	《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	2023 年 04 月 07 日
8	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (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	2023 年 04 月 11 日
9	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (A 类基金份额) (LOF) 基金产品资料概要 (更新)	《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	2023 年 04 月 11 日
10	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (C 类基金份额) (LOF) 基金产品资料概要 (更新)	《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	2023 年 04 月 11 日
11	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2023 年第 1 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	2023 年 04 月 21 日
12	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购航天软件首次公开发行 A 股的公告	《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	2023 年 05 月 17 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票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	2023 年 05 月 19 日

14	鹏华基金管理有限公司关于注意防范以协助办理贷款为借口进行诈骗活动的风险提示	《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	2023 年 06 月 03 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国海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	2023 年 06 月 05 日
16	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	2023 年 06 月 06 日
17	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京中植基金销售有限公司申购（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	2023 年 06 月 20 日
18	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购豪恩汽电首次公开发行 A 股的公告	《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	2023 年 06 月 28 日

注：无。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101~20230630	243,896,621.32	0.00	0.00	243,896,621.32	22.82

#### 产品特有风险

基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

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

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- (二)《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- (三)《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2023 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

2023 年 8 月 30 日