

鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资
基金
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

§ 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	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§ 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	10
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	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
§ 5 托管人报告	13
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	70
7.1 期末基金资产组合情况	70
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	70
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	72
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	85
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	87

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	87
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	87
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	87
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	87
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	87
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	87
7.12 投资组合报告附注	88
§ 8 基金份额持有人信息	89
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	89
8.2 期末上市基金前十名持有人	89
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	90
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	90
§ 9 开放式基金份额变动	90
§ 10 重大事件揭示	90
10.1 基金份额持有人大会决议	90
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	90
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	91
10.4 基金投资策略的改变	91
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	91
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	91
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	91
10.8 其他重大事件	93
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	95
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	95
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	95
§ 12 备查文件目录	95
12.1 备查文件目录	95
12.2 存放地点	95
12.3 查阅方式	95

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证 500
场内简称	中证 500ETF 鹏华
基金主代码	159982
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 11 月 21 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	286,211,253.00 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	2020 年 2 月 20 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年跟踪误差控制在 2% 以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>(1) 股票投资组合的构建 本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p>(2) 股票投资组合的调整 本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况，对其进行适时调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。</p> <p>1) 定</p>

	<p>期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。 2) 不定期调整 根据指数编制规则,当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时,本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整; 根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数; 根据法律、法规规定,成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的,本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。 (3) 存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略,基于对基础证券投资价值的深入研究判断,进行存托凭证的投资。 2、债券投资策略 本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化,并利用债券定价技术,进行个券选择。 3、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,提高投资效率,从而更好地跟踪标的指数,实现投资目标。同时,本基金将力争利用股指期货的杠杆作用,降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,从而达到稳定投资组合资产净值的目的。 基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。 4、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。 5、参与融资及转融通证券出借业务策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上,参与融资业务。 为更好地实现投资目标,在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下,本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上,合理确定出借证券的范围、期限和比例。 本基金将密切跟踪国内关于基金参与融券业务法律法规的实施进展,待允许本基金参与融券业务的相关规定颁布后,将在届时相应法律法规的框架内,参与融券业务。 未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书中更新公告。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金,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。同时本基金为交易型开放式指数基金,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

注:无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	高永杰	郭明
	联系电话	0755-81395402	(010)66105799
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	(010)66105798
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		何如	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,505,607.28
本期利润	14,288,172.77
加权平均基金份额本期利润	0.0555
本期加权平均净值利润率	3.75%
本期基金份额净值增长率	4.17%
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	129,501,677.74
期末可供分配基金份额利润	0.4525
期末基金资产净值	415,712,930.74
期末基金份额净值	1.4525
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	45.25%

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

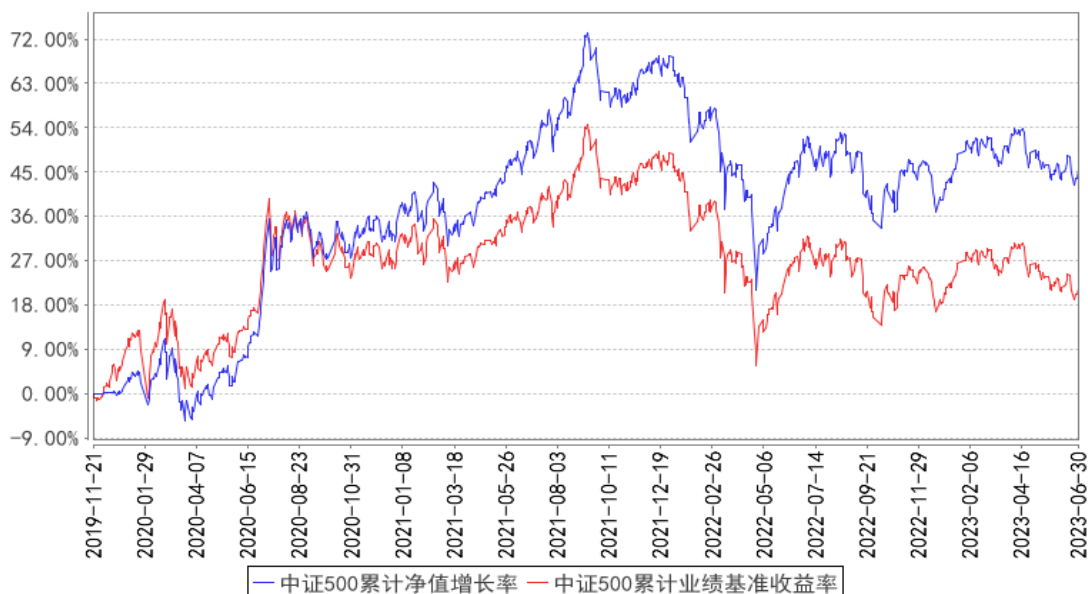
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.08%	0.93%	-0.81%	0.93%	0.89%	0.00%
过去三个月	-3.74%	0.81%	-5.38%	0.83%	1.64%	-0.02%
过去六个月	4.17%	0.77%	2.29%	0.79%	1.88%	-0.02%
过去一年	-3.60%	0.94%	-7.06%	0.96%	3.46%	-0.02%
过去三年	27.45%	1.17%	2.29%	1.19%	25.16%	-0.02%
自基金合同生效起至今	45.25%	1.20%	21.28%	1.27%	23.97%	-0.07%

注：业绩比较基准=中证 500 指数收益率

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

中证500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 2019 年 11 月 21 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		
陈龙	基金经理	2019-11-21	-	14 年	陈龙先生，国籍中国，经济学硕士，14 年证券从业经验。曾任杭州衡泰软件公司金融工程师，2009 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部金融工程总监助理、量化及衍生品投资部量化研究总监助理，先后从事金融工程、量化研究等工作，现任量化及衍生品投资部量化研究副总经理、基金经理。2015 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 07 月至 2018 年 04 月担任鹏华创业板指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 04 月担任鹏华中证 800 地产指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华港股通中证香港中小企业投资主题指数证券投资基金（LOF）基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 04 月担任鹏华中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至今担任鹏华

					<p>中证空天一体军工指数证券投资基金（LOF）基金经理, 2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理, 2019 年 11 月至今担任鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2019 年 12 月至 2022 年 10 月担任鹏华国证证券龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2020 年 01 月至今担任鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2021 年 01 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证全指证券公司指数型证券投资基金（LOF）基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）基金经理, 2021 年 01 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证 800 证券保险指数型证券投资基金（LOF）基金经理, 2021 年 02 月至今担任鹏华中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 08 月至今担任鹏华中证国防交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 02 月至今担任鹏华国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 陈龙先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。</p>
--	--	--	--	--	---

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

本报告期内，本基金运作合规，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，本报告期鹏华中证 500ETF 份额净值增长率为 4.17%，同期业绩比较基准增长率为 2.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在年中时点去复盘过去半年股债大类资产的表现，会发现实际情况与年初的预期正好相反。站在年初时点，市场的一致预期是今年将会以来疫后复苏的年份，大类资产方面会表现为股强债弱，但实际市场走出来的是股弱债强，本质上还是对经济及政策的预期出现了较大的偏差。

今年 3 月份，两会政府工作报告定调全年经济增长目标为 5% 左右，引发市场对经济预期的下修，但随后 3 月份强劲的经济数据再次提振了市场对经济复苏的乐观预期。进入二季度后，随着疫后脉冲式复苏的消退，居民、企业以及地方政府等主体资产负债表约束开始显现，叠加海外发达经济体主动去库存，地产销售、出口及消费均显著趋弱，经济再次出现二次探底。但由于去年低基数的效应，预计上半年经济增速仍维持在较高水平，而中性情景下，预计完成全年的经济增长目标也并不会构成较大的挑战。

从这个角度看，今年政策的着力点会适当淡化短期稳增长的目标，而更加聚焦中长期产业发展新格局的构建，即为未来 3-5 年的新一轮经济可持续增长奠定好的基础。而上述政策目标的设定，意味着今年整个宏观经济会呈现出下有底、上有顶的弱复苏态势。而映射到 A 股市场，我们也会同样会看到上市公司整体的盈利缺乏向上的弹性，指数整体也表现出跟宏观经济类似的状态，即下有底，但向上缺乏弹性。

展望下半年，一方面当前市场已经对 7 月份重要会议的政策预期比较低，我们也倾向于认为当下“经济弱复苏”、“政策弱刺激”状态可能会贯穿全年；另一方面，外部的流动性环境有望在

4 季度迎来积极的变化。近期美国公布的 6 月份 CPI 数据超预期回落，也引发了市场对加息周期即将结束的乐观预期。我们预计更明确的加息结束的信号有望在 4 季度出现，即 9 月份的议息会议之后，届时汇率对国内进一步宽松政策的掣肘有望显著降低。因此，从时间节奏上看，我们会更加看好 4 季度 A 股的表现，而 3 季度可能还是要经历一个磨底的过程。

板块结构方面，以 AI 为代表的科技链依然是全年的主线，目前看仍然处在产业发展的初期，未来随着技术的突破，以及应用场景的落地，业绩有望逐步兑现，从而驱动新一轮行情；而复苏链的悲观预期释放较为充分，底部逐步明朗，未来有望在内外部政策驱动下走出脉冲式的修复行情。另外，部分基本面较为独立的方向，如国防军工、农业中的种植产业链等在下半年有望迎来拐点型的变化，当下的赔率较为有吸引力，随着时间的推移，胜率也在不断提升，且当下市场关注度也极低，未来存在较大的预期差。

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 129,501,677.74 元，期末基金份额净值 1.4525 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：鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	11,714,543.40	9,213,589.85
结算备付金		8,617,168.83	8,550,735.13
存出保证金		2,033,426.32	1,915,009.33
交易性金融资产	6.4.7.2	393,369,141.19	332,510,595.62
其中：股票投资		393,369,141.19	332,510,595.62
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		248,267.41	217,033.45
应收股利		34,431.23	1,485.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	17,518.43	10,632.64
资产总计		416,034,496.81	352,419,081.02
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		51,328.68	46,139.47
应付托管费		17,109.54	15,379.84
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,117.71	1,603.98
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	250,010.14	689,504.70
负债合计		321,566.07	752,627.99
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	286,211,253.00	252,211,253.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	129,501,677.74	99,455,200.03
净资产合计		415,712,930.74	351,666,453.03
负债和净资产总计		416,034,496.81	352,419,081.02

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4525 元，基金份额总额 286,211,253.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

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
一、营业总收入		14,818,224.19	-40,399,955.00
1. 利息收入		380,926.68	396,877.87
其中：存款利息收入	6.4.7.13	62,187.17	60,202.81
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		318,739.51	336,675.06
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,441,387.04	-3,932,976.95
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,131,718.89	-6,258,822.29
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	23,817.25	-1,678,858.66
股利收益	6.4.7.19	4,549,288.68	4,004,704.00
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	10,782,565.49	-37,159,884.84
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	213,344.98	296,028.92
减：二、营业总支出		530,051.42	520,771.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	283,258.60	274,142.22
2. 托管费	6.4.10.2.2	94,419.52	91,380.72
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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		1, 623. 04	597. 33
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	150, 750. 26	154, 651. 70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14, 288, 172. 77	-40, 920, 726. 97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14, 288, 172. 77	-40, 920, 726. 97
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		14, 288, 172. 77	-40, 920, 726. 97

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

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)	252, 211, 253. 00	-	99, 455, 200. 03	351, 666, 453. 03
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)	252, 211, 253. 00	-	99, 455, 200. 03	351, 666, 453. 03
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	34, 000, 000. 00	-	30, 046, 477. 71	64, 046, 477. 71
(一)、综合收益总额	-	-	14, 288, 172. 77	14, 288, 172. 77

(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)	34,000,000.00	-	15,758,304.94	49,758,304.94
其中:1. 基金申购款	56,000,000.00	-	26,817,888.44	82,817,888.44
2 .基金赎回款	-22,000,000.00	-	-11,059,583.50	-33,059,583.50
(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)	286,211,253.00	-	129,501,677.74	415,712,930.74
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 金净值)	232,211,253.00	-	159,219,602.45	391,430,855.45

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)	232,211,253.00	-	159,219,602.45	391,430,855.45
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	18,000,000.00	-	-32,429,378.25	-14,429,378.25
(一)、综合收益总额	-	-	-40,920,726.97	-40,920,726.97
(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)	18,000,000.00	-	8,491,348.72	26,491,348.72
其中:1.基金申购款	48,000,000.00	-	22,890,874.38	70,890,874.38
2.基金赎回款	-30,000,000.00	-	-14,399,525.66	-44,399,525.66
(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)	250,211,253.00	-	126,790,224.20	377,001,477.20

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

鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]第 1504 号《关于准予鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 490,173,730.00 元(含募集股票市值),经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0669 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 11 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 490,211,253.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 37,523.00 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》、《鹏华中证 500 交易型开放式指数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 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	11,714,543.40
等于：本金	11,713,566.04
加：应计利息	977.36
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	11,714,543.40

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	399,374,326.01	-	393,369,141.19	-6,005,184.82
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	399,374,326.01	-	393,369,141.19	-6,005,184.82

注：股票投资的公允价值和股票投资的公允价值变动均含可退替代款估值增值。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生 工具	-	-	-	
货币衍生 工具	-	-	-	
权益衍生 工具	16,848,120.00	-	-	
其中：股指 期货投资	16,848,120.00	-	-	
其他衍生 工具	-	-	-	
合计	16,848,120.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2309	IC2309	14.00	16,716,000.00	-132,120.00
合计				-132,120.00
减：可抵销期货 暂收款				-132,120.00
净额				0.00

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	17,518.43
待摊费用	-
合计	17,518.43

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	134,675.10
其中：交易所市场	134,675.10
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	80,335.04
应付指数使用费	35,000.00
合计	250,010.14

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	252,211,253.00	252,211,253.00
本期申购	56,000,000.00	56,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-22,000,000.00	-22,000,000.00
- 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	286,211,253.00	286,211,253.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

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

上年度末	132,021,027.38	-32,565,827.35	99,455,200.03
本期利润	3,505,607.28	10,782,565.49	14,288,172.77
本期基金份额交易产生的变动数	18,268,027.34	-2,509,722.40	15,758,304.94
其中：基金申购款	29,859,673.42	-3,041,784.98	26,817,888.44
基金赎回款	-11,591,646.08	532,062.58	-11,059,583.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	153,794,662.00	-24,292,984.26	129,501,677.74

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	15,899.19	
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	44,763.99	
其他	1,523.99	
合计	62,187.17	

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	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	-1,641,157.94	
股票投资收益——赎回差价收入	509,439.05	
股票投资收益——申购差价收入	-	
股票投资收益——证券出借差价收入	-	
合计	-1,131,718.89	

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	73,158,848.47	
减：卖出股票成本总额	74,559,301.70	
减：交易费用	240,704.71	
买卖股票差价收入	-1,641,157.94	

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	33,059,583.50
减：现金支付赎回款总额	17,323,730.50
减：赎回股票成本总额	15,226,413.95
减：交易费用	-
赎回差价收入	509,439.05

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 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

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	23,817.25

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	4,549,288.68
其中：证券出借权益补偿收入	384,028.11
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,549,288.68

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	10,446,325.49
股票投资	10,446,325.49
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	336,240.00
权证投资	-
期货投资	336,240.00
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	10,782,565.49

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	-
替代损益	213,344.98
合计	213,344.98

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

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	20,827.67
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	315.00
指数使用费	70,000.00
存托服务费	100.22
合计	150,750.26

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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、基金的一级交易商
鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“鹏华中证 500ETF 联接”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

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 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	
	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	44,387,247.90	26.82	8,309,619.05	4.26

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	40,894.17	26.91	40,894.17	30.37
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	7,637.07	4.28	5,921.69	4.50
------	----------	------	----------	------

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	283,258.60	274,142.22
其中：支付销售机构的客户维护费	4,532.76	589.77

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 0.15%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.15%÷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	94,419.52	91,380.72

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 0.05%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×0.05%/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

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
-	-	-	-	-
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
国信证券	6,841,161.00	4,550.49	638,040.00	65.11

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	202212230009166	红日药业	2022年12月23日	11,220.00	2,000	14	3.20	5.96	-	-
国信证券	20230508000547	滨江集团	2023年5月8日	107,360.00	11,000	14	3.10	129.43	-	-

	3		日							
国信证券	202305220017290	滨江集团	2023年5月22日	96,360.00	11,000	14	3.10	116.17	-	-
国信证券	202305240003613	滨江集团	2023年5月24日	12,465.00	1,500	14	3.10	15.03	-	-
国信证券	202305250005214	云南铜业	2023年5月25日	32,730.00	3,000	14	3.10	39.46	-	-
国信证券	202306010004056	石基信息	2023年6月1日	119,460.00	6,000	14	3.10	144.02	-	-
国信证券	202306050023908	滨江集团	2023年6月5日	93,830.00	11,000	14	3.10	113.12	-	-
国信证券	202306060003706	小商品城	2023年6月6日	151,101.00	16,300	14	3.10	182.16	-	-
国信证券	202306070016309	滨江集团	2023年6月7日	13,395.00	1,500	14	3.10	16.15	-	-
国信证券	202306190023547	滨江集团	2023年6月19日	99,550.00	11,000	14	3.10	94.27	97,020.00	94.27
国信证券	202306200032165	小商品城	2023年6月20日	143,114.00	16,300	14	3.10	123.20	139,039.00	123.20
国信证券	202306210017001	滨江集团	2023年6月21日	13,365.00	1,500	14	3.10	10.35	13,230.00	10.35
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日										
关联方	合约	证券	成交	交易金	交易	出	费	利息	期末	期末应

名称	编号	名称	时间	额	数量 (单 位: 股)	借 期 限 (单 位: 天)	率 (%)	收入	证券 出借 业务 余额	收利息 余额
国信证券	20220 11100 01198 3	掌趣 科技	2022- 1-11	20,460.0 0	4,400	14	3.20	25.46	-	-
国信证券	20220 11700 00094 4	捷成 股份	2022- 1-17	25,230.0 0	3,000	14	3.20	47.10	-	-
国信证券	20220 11900 00079 4	万达 信息	2022- 1-19	88,288.0 0	6,200	14	3.20	149.11	-	-
国信证券	20220 11900 00079 6	长信 科技	2022- 1-19	108,252. 00	9,300	14	3.20	182.82	-	-
国信证券	20220 11900 00079 7	网宿 科技	2022- 1-19	40,768.0 0	5,600	14	3.20	68.85	-	-
国信证券	20220 11900 00079 0	蓝色 光标	2022- 1-19	90,885.0 0	8,300	14	3.20	153.49	-	-
国信证券	20220 12100 00088 3	红日 药业	2022- 1-21	20,670.0 0	3,000	14	3.20	31.23	-	-
国信证券	20220 12100 00089 1	机器 人	2022- 1-21	58,250.0 0	5,000	14	3.20	88.02	-	-
国信证券	20220 20700 04681 9	红日 药业	2022- 2-7	18,540.0 0	3,000	14	3.20	23.07	-	-
国信证券	20220	蓝色	2022-	70,965.0	8,300	14	3.20	88.31	-	-

	20700 04681 1	光标	2-7	0						
国信证券	20220 20700 04681 3	长信 科技	2022- 2-7	91,977.0 0	9,300	14	3.20	114.46	-	-
国信证券	20220 20700 04682 3	捷成 股份	2022- 2-7	18,600.0 0	3,000	14	3.20	23.15	-	-
国信证券	20220 20700 04684 3	万达 信息	2022- 2-7	73,904.0 0	6,200	14	3.20	91.97	-	-
国信证券	20220 22100 03784 1	蓝色 光标	2022- 2-21	67,811.0 0	8,300	14	3.20	84.39	-	-
国信证券	20220 22100 03784 3	长信 科技	2022- 2-21	92,256.0 0	9,300	14	3.20	114.81	-	-
国信证券	20220 22100 03783 9	红日 药业	2022- 2-21	18,840.0 0	3,000	14	3.20	23.45	-	-
国信证券	20220 22100 04756 3	捷成 股份	2022- 2-21	19,830.0 0	3,000	14	3.20	24.68	-	-
国信证券	20220 22200 00094 3	红日 药业	2022- 2-22	19,260.0 0	3,000	14	3.20	23.97	-	-
国信证券	20220 22200 00094 5	网宿 科技	2022- 2-22	21,840.0 0	3,000	14	3.20	27.18	-	-
国信证券	20220 22300 00091 4	红日 药业	2022- 2-23	20,250.0 0	3,000	14	3.20	25.20	-	-
国信证券	20220	蓝色	2022-	42,728.0	5,600	14	3.20	53.17	-	-

	30700 04264 8	光标	3-7	0						
国信证券	20220 30700 03536 2	捷成 股份	2022- 3-7	17,430.0 0	3,000	14	3.20	21.69	-	-
国信证券	20220 30700 03808 2	红日 药业	2022- 3-7	20,490.0 0	3,000	14	3.20	25.50	-	-
国信证券	20220 30700 03535 6	长信 科技	2022- 3-7	82,398.0 0	9,300	14	3.20	102.54	-	-
国信证券	20220 30800 01366 6	红日 药业	2022- 3-8	18,240.0 0	3,000	14	3.20	22.70	-	-
国信证券	20220 30800 01597 4	网宿 科技	2022- 3-8	18,750.0 0	3,000	14	3.20	23.33	-	-
国信证券	20220 30900 01808 5	红日 药业	2022- 3-9	17,610.0 0	3,000	14	3.20	21.91	-	-
国信证券	20220 32100 02844 1	捷成 股份	2022- 3-21	17,850.0 0	3,000	14	3.20	25.38	-	-
国信证券	20220 32100 02843 7	红日 药业	2022- 3-21	27,660.0 0	3,000	14	3.20	39.34	-	-
国信证券	20220 32100 02941 3	蓝色 光标	2022- 3-21	45,696.0 0	5,600	14	3.20	64.99	-	-
国信证券	20220 32200 01270 7	红日 药业	2022- 3-22	25,470.0 0	3,000	14	3.20	33.96	-	-
国信证券	20220	红日	2022-	25,020.0	3,000	14	3.20	31.14	-	-

	32300 01373 5	药业	3-23	0						
国信证券	20220 32300 00115 4	蓝色 光标	2022- 3-23	40,900.0 0	5,000	14	3.20	50.90	-	-
国信证券	20220 40600 06241 9	蓝色 光标	2022- 4-6	44,050.0 0	5,000	14	3.20	54.82	-	-
国信证券	20220 40600 06241 7	蓝色 光标	2022- 4-6	49,336.0 0	5,600	14	3.20	61.40	-	-
国信证券	20220 40600 06241 1	红日 药业	2022- 4-6	24,990.0 0	3,000	14	3.20	31.10	-	-
国信证券	20220 40600 06241 3	红日 药业	2022- 4-6	24,990.0 0	3,000	14	3.20	31.10	-	-
国信证券	20220 40600 06241 5	红日 药业	2022- 4-6	24,990.0 0	3,000	14	3.20	31.10	-	-
国信证券	20220 40600 05110 3	捷成 股份	2022- 4-6	18,750.0 0	3,000	14	3.20	23.33	-	-
国信证券	20220 40700 00096 1	红日 药业	2022- 4-7	24,540.0 0	3,000	14	3.20	30.54	-	-
国信证券	20220 42000 04482 4	红日 药业	2022- 4-20	18,660.0 0	3,000	14	3.20	24.88	-	-
国信证券	20220 42000 04482 6	红日 药业	2022- 4-20	18,660.0 0	3,000	14	3.20	24.88	-	-
国信证券	20220	红日	2022-	18,660.0	3,000	14	3.20	24.88	-	-

	42000 04482 8	药业	4-20	0						
国信证券	20220 42000 04483 0	蓝色 光标	2022- 4-20	37,072.0 0	5,600	14	3.20	49.43	-	-
国信证券	20220 42000 04483 2	蓝色 光标	2022- 4-20	33,100.0 0	5,000	14	3.20	44.13	-	-
国信证券	20220 42000 04483 4	捷成 股份	2022- 4-20	14,940.0 0	3,000	14	3.20	19.92	-	-
国信证券	20220 42100 01368 1	红日 药业	2022- 4-21	18,120.0 0	3,000	14	3.20	22.55	-	-
国信证券	20220 42100 00137 9	蓝色 光标	2022- 4-21	18,990.0 0	3,000	14	3.20	23.63	-	-
国信证券	20220 50500 07253 3	捷成 股份	2022- 5-5	14,520.0 0	3,000	14	3.20	18.07	-	-
国信证券	20220 50500 07252 5	蓝色 光标	2022- 5-5	31,920.0 0	5,600	14	3.20	39.72	-	-
国信证券	20220 50500 07252 7	蓝色 光标	2022- 5-5	28,500.0 0	5,000	14	3.20	35.47	-	-
国信证券	20220 50500 07252 9	蓝色 光标	2022- 5-5	17,100.0 0	3,000	14	3.20	21.28	-	-
国信证券	20220 50500 07251 7	红日 药业	2022- 5-5	17,760.0 0	3,000	14	3.20	22.10	-	-
国信证券	20220	红日	2022-	17,760.0	3,000	14	3.20	22.10	-	-

	50500 07251 9	药业	5-5	0						
国信证券	20220 50500 07252 1	红日 药业	2022- 5-5	17,760.0 0	3,000	14	3.20	22.10	-	-
国信证券	20220 50500 07252 3	红日 药业	2022- 5-5	17,760.0 0	3,000	14	3.20	22.10	-	-
国信证券	20220 51900 04142 3	红日 药业	2022- 5-19	17,460.0 0	3,000	14	3.20	21.73	-	-
国信证券	20220 51900 04142 5	红日 药业	2022- 5-19	17,460.0 0	3,000	14	3.20	21.73	-	-
国信证券	20220 51900 04142 7	红日 药业	2022- 5-19	17,460.0 0	3,000	14	3.20	21.73	-	-
国信证券	20220 51900 04142 9	红日 药业	2022- 5-19	17,460.0 0	3,000	14	3.20	21.73	-	-
国信证券	20220 51900 04143 1	蓝色 光标	2022- 5-19	29,050.0 0	5,000	14	3.20	36.15	-	-
国信证券	20220 51900 04143 3	蓝色 光标	2022- 5-19	17,430.0 0	3,000	14	3.20	21.69	-	-
国信证券	20220 51900 04144 5	蓝色 光标	2022- 5-19	32,536.0 0	5,600	14	3.20	40.49	-	-
国信证券	20220 51900 04144 7	捷成 股份	2022- 5-19	14,700.0 0	3,000	14	3.20	18.29	-	-
国信证券	20220	蓝色	2022-	30,500.0	5,000	14	3.20	37.96	-	-

	60200 01370 4	光标	6-2	0						
国信证券	20220 60200 01370 6	蓝色 光标	2022- 6-2	34,160.0 0	5,600	14	3.20	42.51	-	-
国信证券	20220 60200 01370 8	蓝色 光标	2022- 6-2	18,300.0 0	3,000	14	3.20	22.77	-	-
国信证券	20220 60200 01369 6	红日 药业	2022- 6-2	16,260.0 0	3,000	14	3.20	20.23	-	-
国信证券	20220 60200 01369 8	红日 药业	2022- 6-2	16,260.0 0	3,000	14	3.20	20.23	-	-
国信证券	20220 60200 01370 0	红日 药业	2022- 6-2	16,260.0 0	3,000	14	3.20	20.23	-	-
国信证券	20220 60200 01370 2	红日 药业	2022- 6-2	16,260.0 0	3,000	14	3.20	20.23	-	-
国信证券	20220 60700 00133 6	红日 药业	2022- 6-7	29,800.0 0	5,000	14	3.20	37.08	-	-
国信证券	20220 61600 01590 5	红日 药业	2022- 6-16	17,850.0 0	3,000	14	3.20	22.21	-	-
国信证券	20220 61600 01590 7	红日 药业	2022- 6-16	17,850.0 0	3,000	14	3.20	22.21	-	-
国信证券	20220 61600 01590 9	红日 药业	2022- 6-16	17,850.0 0	3,000	14	3.20	22.21	-	-
国信证券	20220	红日	2022-	17,850.0	3,000	14	3.20	22.21	-	-

	61600 01795 9	药业	6-16	0							
国信证券	20220 61600 01796 1	蓝色 光标	2022- 6-16	34,550.0 0	5,000	14	3.20	43.00	-	-	
国信证券	20220 61600 01796 3	蓝色 光标	2022- 6-16	38,696.0 0	5,600	14	3.20	48.16	-	-	
国信证券	20220 61600 01796 5	蓝色 光标	2022- 6-16	20,730.0 0	3,000	14	3.20	25.80	-	-	
国信证券	20220 62100 00941 4	红日 药业	2022- 6-21	34,250.0 0	5,000	14	3.20	42.62	38,500 .00	27.40	
国信证券	20220 63000 02109 7	蓝色 光标	2022- 6-30	36,568.0 0	5,600	14	3.20	45.51	36,568 .00	-	
国信证券	20220 63000 02109 3	红日 药业	2022- 6-30	23,100.0 0	3,000	14	3.20	28.75	23,100 .00	-	
国信证券	20220 63000 02109 5	红日 药业	2022- 6-30	23,100.0 0	3,000	14	3.20	28.75	23,100 .00	-	
国信证券	20220 63000 02109 9	蓝色 光标	2022- 6-30	19,590.0 0	3,000	14	3.20	24.38	19,590 .00	-	
国信证券	20220 63000 02109 1	红日 药业	2022- 6-30	23,100.0 0	3,000	14	3.20	28.75	23,100 .00	-	

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
鹏华中证500ETF联接	113,604,637.00	39.69	62,577,637.00	24.81

注：除基金管理人以外的其他关联方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。

6.4.10.6 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	11,714,543.40	15,899.19	10,108,933.33	16,592.05

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	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	6,732	85,361.76
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	2,244	89,266.32
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

无。

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	444	5,274.72	9,332.88	-
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	120	2,481.60	3,058.80	-
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	213	7,242.00	7,440.09	-
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	2,538	65,531.16	65,531.16	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	25.82	25.82	283	7,307.06	7,307.06	-
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	1,750	64,575.00	64,575.00	-

301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	195	7,195.50	7,195.50	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	365	11,030.30	9,307.50	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	44.18	25.10	295	9,321.98	7,404.50	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	393	14,985.09	12,194.79	-
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	5,136	102,668.64	102,668.64	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	571	11,414.29	11,414.29	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	300	8,880.00	21,426.00	-
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	2,922	14,610.00	26,181.12	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股流通受限	26.80	22.32	587	15,731.60	13,101.84	-
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	143	12,455.45	7,613.32	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	164	12,595.20	17,703.80		-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流 通受限	14.81	13.73	735	10,885.35	10,091.55		-
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	126	9,254.70	5,876.64		-
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	171	8,550.00	8,274.69		-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流 通受限	23.77	42.89	378	8,985.06	16,212.42		-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股流 通受限	71.88	92.60	131	9,416.28	12,130.60		-
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	360	8,877.60	8,103.60		-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流 通受限	23.80	32.84	369	8,782.20	12,117.96		-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	29.99	23.79	330	9,896.70	7,850.70		-
301399	英特科技	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流 通受限	43.99	51.57	281	12,361.19	14,491.17		-

301408	华人健康	2023年 2月22日	6个月	新股流 通受限	16.24	16.95	732	11,887.68	12,407.40	-
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	443	8,855.57	7,486.70	-
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	2,050	118,203.00	118,203.00	-
301486	致尚科技	2023年 6月30日	6个月	新股流 通受限	57.66	57.66	228	13,146.48	13,146.48	-
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	2,019	80,315.82	80,315.82	-
301488	豪恩汽电	2023年 6月26日	6个月	新股流 通受限	39.78	39.78	225	8,950.50	8,950.50	-
601061	中信金属	2023年 3月30日	6个月	新股流 通受限	6.58	7.58	1,010	6,645.80	7,655.80	-
601065	江盐集团	2023年 3月31日	6个月	新股流 通受限	10.36	11.84	331	3,429.16	3,919.04	-
601133	柏诚股份	2023年 3月31日	6个月	新股流 通受限	11.66	12.26	292	3,404.72	3,579.92	-
603125	常青科技	2023年 3月30日	6个月	新股流 通受限	25.98	24.53	109	2,831.82	2,673.77	-
603135	中重科技	2023年 3月29日	6个月	新股流 通受限	17.80	17.89	335	5,963.00	5,993.15	-
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	-

		日									
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	327	11,821.05	12,468.51		-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	1,765	35,052.90	31,875.90		-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	652	9,232.32	10,568.92		-
688352	颀中科技	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	894	10,817.40	10,790.58		-
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	376	8,873.60	24,315.92		-
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	269	7,171.54	8,473.50		-
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	572	21,667.36	16,868.28		-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	75.00	90.76	137	10,275.00	12,434.12		-
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	3,257	18,532.33	17,620.37		-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	1,489	16,527.90	25,372.56		-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	32.52	42.37	382	12,422.64	16,185.34		-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	33.99	29.49	211	7,171.89	6,222.39		-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	245.56	122.11	73	12,032.44	8,914.03		索辰科技于2023年6月20日每10

											股送 4.8 股
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	104	15,847.52	14,140.88		-
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	229	10,000.43	12,148.45		-
688562	航天软件	2023年 5月15 日	6个月	新股流 通受限	12.68	22.31	674	8,546.32	15,036.94		-
688570	天玛智控	2023年 5月29 日	6个月	新股流 通受限	30.26	25.33	427	12,921.02	10,815.91		-
688581	安杰思	2023年 5月12 日	6个月	新股流 通受限	125.80	118.03	92	11,573.60	10,858.76		-
688582	芯动联科	2023年 6月21 日	6个月	新股流 通受限	26.74	40.68	304	8,128.96	12,366.72		-
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	823	8,789.64	10,155.82		-
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	238	6,016.64	7,109.06		-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项	6.97	2023年7月3日	7.40	40,400	237,049.07	281,588.00	-
000540	*ST中天	2023年5月19日	退市	0.11	-	-	286,500	500,813.56	31,515.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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	000009	中国宝安	2023年7月3日-2023年7月12日	12.07	9,900	119,493.00
2	000012	南玻A	2023年7月10日	5.96	14,000	83,440.00
3	000021	深科技	2023年7月13日	19.99	10,000	199,900.00
4	000031	大悦城	2023年7月10日	3.66	1,000	3,660.00
5	000039	中集集团	2023年7月4日	6.89	5,400	37,206.00
6	000060	中金岭南	2023年7月4日-2023年7月13日	4.75	26,400	125,400.00
7	000066	中国长城	2023年7月11日	13.83	6,000	82,980.00
8	000089	深圳机场	2023年7月14日	6.95	10,000	69,500.00
9	000155	川能动力	2023年7月14日	14.40	7,000	100,800.00
10	000156	华数传媒	2023年7月10日-2023年7月13日	8.70	8,600	74,820.00
11	000400	许继电气	2023年7月10日	23.05	1,700	39,185.00
12	000401	冀东水泥	2023年7月10日-2023年7月12日	7.37	10,100	74,437.00
13	000402	金融街	2023年7月4日	4.52	12,000	54,240.00
14	000415	渤海租赁	2023年7月3日	2.10	10,000	21,000.00
15	000423	东阿阿胶	2023年7月14日	53.45	4,500	240,525.00
16	000519	中兵红箭	2023年7月5日	18.09	1,000	18,090.00
17	000537	广宇发展	2023年7月10日	11.67	5,000	58,350.00
18	000547	航天发展	2023年7月4日-2023年7月11日	10.00	11,400	114,000.00
19	000553	安道麦A	2023年7月10日	8.44	3,000	25,320.00
20	000559	万向钱	2023年7月5日-2023年	5.45	13,500	73,575.00

		潮	7月12日			
21	000591	太阳能	2023年7月3日-2023年7月5日	6.78	21,100	143,058.00
22	000598	兴蓉环境	2023年7月10日	5.43	16,000	86,880.00
23	000629	钒钛股份	2023年7月4日-2023年7月13日	3.91	43,500	170,085.00
24	000636	风华高科	2023年7月13日	15.34	8,000	122,720.00
25	000703	恒逸石化	2023年7月4日	6.78	22,000	149,160.00
26	000739	普洛药业	2023年7月4日	17.74	5,800	102,892.00
27	000807	云铝股份	2023年7月3日-2023年7月11日	12.73	4,600	58,558.00
28	000831	中国稀土	2023年7月4日-2023年7月13日	29.60	5,400	159,840.00
29	000887	中鼎股份	2023年7月3日-2023年7月5日	13.09	7,900	103,411.00
30	000930	中粮科技	2023年7月13日	8.10	2,000	16,200.00
31	000933	神火股份	2023年7月10日-2023年7月11日	13.00	16,300	211,900.00
32	000937	冀中能源	2023年7月10日-2023年7月13日	6.38	10,500	66,990.00
33	000958	电投产融	2023年7月10日	4.33	12,000	51,960.00
34	000960	锡业股份	2023年7月10日-2023年7月13日	15.55	10,100	157,055.00
35	000970	中科三环	2023年7月3日-2023年7月10日	12.82	9,800	125,636.00
36	000975	银泰黄金	2023年7月5日	11.70	11,800	138,060.00
37	000987	越秀资本	2023年7月14日	6.35	12,000	76,200.00
38	000988	华工科技	2023年7月14日	38.01	9,000	342,090.00
39	000997	新大陆	2023年7月14日	18.90	7,200	136,080.00
40	001872	招商港口	2023年7月13日	17.27	2,000	34,540.00
41	002008	大族激光	2023年7月11日	26.20	8,700	227,940.00
42	002019	亿帆医药	2023年7月5日	14.60	6,000	87,600.00

		药				
43	002030	达安基因	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 5 日	9.97	9,900	98,703.00
44	002032	苏泊尔	2023 年 7 月 3 日	50.00	1,600	80,000.00
45	002065	东华软件	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	7.06	22,700	160,262.00
46	002078	太阳纸业	2023 年 7 月 12 日	10.69	2,800	29,932.00
47	002092	中泰化学	2023 年 7 月 13 日	6.45	20,000	129,000.00
48	002128	电投能源	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 4 日	13.22	7,300	96,506.00
49	002131	利欧股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 11 日	2.30	68,000	156,400.00
50	002152	广电运通	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 5 日	11.72	11,000	128,920.00
51	002153	石基信息	2023 年 7 月 14 日	14.00	6,000	84,000.00
52	002155	湖南黄金	2023 年 7 月 3 日	12.20	7,000	85,400.00
53	002156	通富微电	2023 年 7 月 10 日	22.60	8,000	180,800.00
54	002183	怡亚通	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 4 日	5.10	7,200	36,720.00
55	002192	融捷股份	2023 年 7 月 10 日	66.83	1,800	120,294.00
56	002195	二三四五	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	2.89	56,000	161,840.00
57	002203	海亮股份	2023 年 7 月 4 日	12.01	1,300	15,613.00
58	002221	东华能源	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 11 日	8.65	9,500	82,175.00
59	002223	鱼跃医疗	2023 年 7 月 3 日	35.99	5,000	179,950.00
60	002240	盛新锂能	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 11 日	31.87	6,600	210,342.00
61	002244	滨江集团	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 5 日	8.82	12,500	110,250.00
62	002249	大洋电机	2023 年 7 月 3 日	5.70	14,000	79,800.00
63	002250	联化科技	2023 年 7 月 10 日	10.46	7,500	78,450.00
64	002268	电科网安	2023 年 7 月 10 日	27.87	6,000	167,220.00

65	002273	水晶光电	2023年7月5日	11.94	1,000	11,940.00
66	002281	光迅科技	2023年7月4日	37.09	3,400	126,106.00
67	002326	永太科技	2023年7月10日	15.29	5,400	82,566.00
68	002340	格林美	2023年7月5日	6.91	50,000	345,500.00
69	002353	杰瑞股份	2023年7月3日-2023年7月12日	25.13	6,300	158,319.00
70	002368	太极股份	2023年7月13日	41.17	3,700	152,329.00
71	002372	伟星新材	2023年7月3日-2023年7月11日	20.54	8,200	168,428.00
72	002373	千方科技	2023年7月5日-2023年7月10日	13.64	11,100	151,404.00
73	002384	东山精密	2023年7月3日	25.90	12,800	331,520.00
74	002407	多氟多	2023年7月10日	19.86	10,000	198,600.00
75	002408	齐翔腾达	2023年7月10日	6.37	14,200	90,454.00
76	002409	雅克科技	2023年7月13日	72.88	2,100	153,048.00
77	002422	科伦药业	2023年7月3日-2023年7月4日	29.68	10,000	296,800.00
78	002432	九安医疗	2023年7月10日	35.21	2,800	98,588.00
79	002439	启明星辰	2023年7月11日	29.76	6,000	178,560.00
80	002444	巨星科技	2023年7月12日	21.88	7,500	164,100.00
81	002463	沪电股份	2023年7月10日-2023年7月11日	20.94	13,800	288,972.00
82	002465	海格通信	2023年7月10日	10.34	16,200	167,508.00
83	002468	申通快递	2023年7月10日	10.82	6,800	73,576.00
84	002487	大金重工	2023年7月10日	30.84	2,500	77,100.00
85	002497	雅化集团	2023年7月13日	17.78	10,000	177,800.00
86	002505	鹏都农牧	2023年7月3日-2023年7月10日	1.89	25,900	48,951.00

87	002506	协鑫集成	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	2.93	48,500	142,105.00
88	002508	老板电器	2023 年 7 月 4 日	25.29	3,500	88,515.00
89	002518	科士达	2023 年 7 月 10 日	40.01	1,700	68,017.00
90	002531	天顺风能	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 13 日	15.23	9,000	137,070.00
91	002532	天山铝业	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 4 日	5.99	20,700	123,993.00
92	002557	洽洽食品	2023 年 7 月 14 日	41.55	2,600	108,030.00
93	002563	森马服饰	2023 年 7 月 4 日	6.22	8,000	49,760.00
94	002572	索菲亚	2023 年 7 月 4 日	17.42	5,700	99,294.00
95	002595	豪迈科技	2023 年 7 月 10 日	35.13	3,500	122,955.00
96	002600	领益智造	2023 年 7 月 3 日	6.91	28,000	193,480.00
97	002608	江苏国信	2023 年 7 月 10 日	7.57	5,500	41,635.00
98	002624	完美世界	2023 年 7 月 5 日	16.89	13,000	219,570.00
99	002625	光启技术	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 11 日	15.26	13,400	204,484.00
100	002653	海思科	2023 年 7 月 14 日	23.60	1,900	44,840.00
101	002683	广东宏大	2023 年 7 月 4 日	29.44	4,600	135,424.00
102	002690	美亚光电	2023 年 7 月 14 日	25.75	3,000	77,250.00
103	002705	新宝股份	2023 年 7 月 10 日	18.03	3,300	59,499.00
104	002738	中矿资源	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 12 日	50.94	5,900	300,546.00
105	002739	万达电影	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 12 日	12.54	13,500	169,290.00
106	002745	木林森	2023 年 7 月 3 日	9.20	7,400	68,080.00
107	002761	浙江建投	2023 年 7 月 10 日	15.18	3,100	47,058.00
108	002791	坚朗五金	2023 年 7 月 14 日	64.71	1,000	64,710.00
109	002831	裕同科技	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 11 日	24.39	3,800	92,682.00
110	002850	科达利	2023 年 7 月 3 日	132.25	1,200	158,700.00

111	002867	周大生	2023 年 7 月 4 日	17.78	3,600	64,008.00
112	002925	盈趣科技	2023 年 7 月 3 日	19.40	2,800	54,320.00
113	002936	郑州银行	2023 年 7 月 3 日	2.30	50,000	115,000.00
114	002939	长城证券	2023 年 7 月 4 日	8.13	10,000	81,300.00
115	002958	青农商行	2023 年 7 月 14 日	2.72	38,000	103,360.00
116	002966	苏州银行	2023 年 7 月 4 日	6.55	30,000	196,500.00
117	003035	南网能源	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 11 日	7.12	15,600	111,072.00
118	300001	特锐德	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 11 日	20.78	7,200	149,616.00
119	300009	安科生物	2023 年 7 月 10 日	10.00	10,000	100,000.00
120	300012	华测检测	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 11 日	19.50	14,000	273,000.00
121	300017	网宿科技	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 12 日	7.11	23,300	165,663.00
122	300024	机器人	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	16.67	18,000	300,060.00
123	300026	红日药业	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 11 日	5.42	21,700	117,614.00
124	300058	蓝色光标	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 11 日	9.67	24,500	236,915.00
125	300070	碧水源	2023 年 7 月 10 日	5.36	19,000	101,840.00
126	300088	长信科技	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 14 日	6.03	24,300	146,529.00
127	300115	长盈精密	2023 年 7 月 3 日	11.91	7,400	88,134.00
128	300118	东方日升	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	25.63	8,700	222,981.00
129	300136	信维通信	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 14 日	20.08	9,400	188,752.00
130	300144	宋城演艺	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	12.40	14,800	183,520.00
131	300182	捷成股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 11 日	6.31	26,800	169,108.00
132	300212	易华录	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 12 日	33.23	6,000	199,380.00
133	300244	迪安诊	2023 年 7 月 12 日	25.63	1,000	25,630.00

		断				
134	300251	光线传媒	2023 年 7 月 5 日	8.09	1,500	12,135.00
135	300296	利亚德	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	6.53	20,000	130,600.00
136	300308	中际旭创	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	147.45	8,500	1,253,325.00
137	300363	博腾股份	2023 年 7 月 3 日	29.59	1,600	47,344.00
138	300373	扬杰科技	2023 年 7 月 4 日	40.57	2,600	105,482.00
139	300383	光环新网	2023 年 7 月 13 日	10.75	12,000	129,000.00
140	300390	天华新能	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 11 日	35.80	6,100	218,380.00
141	300418	昆仑万维	2023 年 7 月 10 日	40.28	8,000	322,240.00
142	300438	鹏辉能源	2023 年 7 月 10 日	48.04	2,300	110,492.00
143	300474	景嘉微	2023 年 7 月 13 日	89.99	1,900	170,981.00
144	300482	万孚生物	2023 年 7 月 5 日	26.63	1,500	39,945.00
145	300558	贝达药业	2023 年 7 月 12 日	48.03	2,000	96,060.00
146	300568	星源材质	2023 年 7 月 5 日	17.19	4,700	80,793.00
147	300595	欧普康视	2023 年 7 月 11 日	30.19	5,500	166,045.00
148	300604	长川科技	2023 年 7 月 13 日	47.49	3,500	166,215.00
149	300618	寒锐钴业	2023 年 7 月 12 日	32.41	2,000	64,820.00
150	300676	华大基因	2023 年 7 月 12 日	59.99	2,000	119,980.00
151	300677	英科医疗	2023 年 7 月 11 日	22.00	4,500	99,000.00
152	300682	朗新科技	2023 年 7 月 4 日	23.28	4,700	109,416.00
153	300724	捷佳伟创	2023 年 7 月 14 日	112.35	2,000	224,700.00
154	300741	华宝股份	2023 年 7 月 13 日	21.42	1,000	21,420.00
155	300776	帝尔激光	2023 年 7 月 10 日	64.90	1,400	90,860.00

		光				
156	300832	新产业	2023 年 7 月 10 日	59.00	2,800	165,200.00
157	300866	安克创新	2023 年 7 月 14 日	87.50	2,000	175,000.00
158	300888	稳健医疗	2023 年 7 月 3 日	41.67	1,200	50,004.00
159	600021	上海电力	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 14 日	10.77	13,600	146,472.00
160	600027	华电国际	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 11 日	6.69	32,000	214,080.00
161	600032	浙江新能	2023 年 7 月 3 日	12.56	1,700	21,352.00
162	600056	中国医药	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 5 日	12.98	7,500	97,350.00
163	600060	海信视像	2023 年 7 月 3 日	24.75	7,000	173,250.00
164	600062	华润双鹤	2023 年 7 月 10 日	17.42	4,000	69,680.00
165	600066	宇通客车	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	14.74	11,800	173,932.00
166	600095	湘财股份	2023 年 7 月 10 日	7.80	7,500	58,500.00
167	600096	云天化	2023 年 7 月 10 日	17.07	11,000	187,770.00
168	600118	中国卫星	2023 年 7 月 4 日	28.21	4,800	135,408.00
169	600141	兴发集团	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 11 日	22.22	8,000	177,760.00
170	600153	建发股份	2023 年 7 月 10 日	10.91	1,200	13,092.00
171	600155	华创云信	2023 年 7 月 10 日	6.22	8,600	53,492.00
172	600157	永泰能源	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	1.42	217,700	309,134.00
173	600160	巨化股份	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 11 日	13.78	14,000	192,920.00
174	600167	联美控股	2023 年 7 月 10 日	6.97	8,000	55,760.00
175	600170	上海建工	2023 年 7 月 14 日	2.69	14,000	37,660.00
176	600171	上海贝岭	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 5 日	18.25	5,000	91,250.00
177	600177	雅戈尔	2023 年 7 月 5 日	6.31	27,000	170,370.00

						0
178	600208	新湖中宝	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 12 日	2.48	5,800	14,384.00
179	600258	首旅酒店	2023 年 7 月 10 日	18.95	6,800	128,860.00
180	600259	广晟有色	2023 年 7 月 5 日	36.14	2,000	72,280.00
181	600297	广汇汽车	2023 年 7 月 3 日	2.08	36,100	75,088.00
182	600299	安迪苏	2023 年 7 月 4 日	7.97	1,700	13,549.00
183	600325	华发股份	2023 年 7 月 10 日	9.85	15,000	147,750.00
184	600329	达仁堂	2023 年 7 月 4 日	44.89	2,500	112,225.00
185	600339	中油工程	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	4.07	11,700	47,619.00
186	600348	华阳股份	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 11 日	7.91	2,500	19,775.00
187	600350	山东高速	2023 年 7 月 14 日	6.37	1,000	6,370.00
188	600372	中航电子	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 10 日	15.18	19,400	294,492.00
189	600373	中文传媒	2023 年 7 月 10 日	13.32	6,800	90,576.00
190	600377	宁沪高速	2023 年 7 月 13 日	9.83	2,500	24,575.00
191	600378	昊华科技	2023 年 7 月 13 日	37.64	2,000	75,280.00
192	600380	健康元	2023 年 7 月 13 日	12.71	10,000	127,100.00
193	600390	五矿资本	2023 年 7 月 5 日	5.38	19,700	105,986.00
194	600392	盛和资源	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 11 日	12.87	11,500	148,005.00
195	600398	海澜之家	2023 年 7 月 3 日	6.88	15,200	104,576.00
196	600409	三友化工	2023 年 7 月 5 日	5.45	2,500	13,625.00
197	600415	小商品城	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 5 日	8.53	22,500	191,925.00
198	600418	江淮汽车	2023 年 7 月 10 日	12.59	15,400	193,886.00
199	600482	中国动力	2023 年 7 月 4 日	23.44	9,500	222,680.00

200	600487	亨通光电	2023 年 7 月 10 日	14.66	17,400	255,084.00
201	600489	中金黄金	2023 年 7 月 10 日	10.33	28,000	289,240.00
202	600497	驰宏锌锗	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 11 日	5.02	30,600	153,612.00
203	600498	烽火通信	2023 年 7 月 13 日	20.37	7,000	142,590.00
204	600499	科达制造	2023 年 7 月 12 日-2023 年 7 月 13 日	11.36	13,200	149,952.00
205	600500	中化国际	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 11 日	5.56	13,900	77,284.00
206	600511	国药股份	2023 年 7 月 10 日	38.85	3,300	128,205.00
207	600516	方大炭素	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 13 日	6.20	24,400	151,280.00
208	600517	国网英大	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	5.70	16,800	95,760.00
209	600521	华海药业	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 10 日	18.41	8,700	160,167.00
210	600528	中铁工业	2023 年 7 月 13 日	9.88	11,000	108,680.00
211	600529	山东药玻	2023 年 7 月 13 日	27.22	4,300	117,046.00
212	600535	天士力	2023 年 7 月 4 日	14.51	3,500	50,785.00
213	600536	中国软件	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	46.88	5,900	276,592.00
214	600546	山煤国际	2023 年 7 月 4 日	14.47	8,200	118,654.00
215	600556	天下秀	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 4 日	7.09	12,500	88,625.00
216	600580	卧龙电驱	2023 年 7 月 4 日	14.61	8,200	119,802.00
217	600582	天地科技	2023 年 7 月 3 日	5.83	16,000	93,280.00
218	600598	北大荒	2023 年 7 月 10 日	13.33	4,000	53,320.00
219	600642	申能股份	2023 年 7 月 5 日	6.99	12,000	83,880.00
220	600655	豫园股份	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	6.86	18,000	123,480.00
221	600663	陆家嘴	2023 年 7 月 5 日	9.87	8,000	78,960.00
222	600667	太极实业	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	7.26	18,000	130,680.00
223	600699	均胜电	2023 年 7 月 5 日	17.64	9,600	169,344.00

		子				0
224	600704	物产中大	2023 年 7 月 3 日	4.94	10,000	49,400.00
225	600705	中航产融	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 12 日	3.83	54,900	210,267.00
226	600707	彩虹股份	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 12 日	4.76	14,500	69,020.00
227	600718	东软集团	2023 年 7 月 4 日	10.66	7,000	74,620.00
228	600739	辽宁成大	2023 年 7 月 4 日	13.15	9,200	120,980.00
229	600764	中国海防	2023 年 7 月 3 日	27.22	1,900	51,718.00
230	600820	隧道股份	2023 年 7 月 4 日	6.01	19,600	117,796.00
231	600839	四川长虹	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	5.05	50,000	252,500.00
232	600848	上海临港	2023 年 7 月 10 日	11.95	1,000	11,950.00
233	600859	王府井	2023 年 7 月 4 日	19.79	4,100	81,139.00
234	600871	石化油服	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 12 日	1.98	41,000	81,180.00
235	600879	航天电子	2023 年 7 月 10 日	8.49	19,000	161,310.00
236	600895	张江高科	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	13.92	6,900	96,048.00
237	600901	江苏金租	2023 年 7 月 14 日	4.13	10,000	41,300.00
238	600928	西安银行	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 5 日	3.52	13,400	47,168.00
239	600956	新天绿能	2023 年 7 月 3 日	8.72	2,400	20,928.00
240	600959	江苏有线	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	3.38	26,700	90,246.00
241	600967	内蒙一机	2023 年 7 月 11 日	10.10	8,000	80,800.00
242	600968	海油发展	2023 年 7 月 14 日	3.07	20,000	61,400.00
243	600985	淮北矿业	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 10 日	11.52	9,900	114,048.00
244	600988	赤峰黄金	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 11 日	13.46	17,200	231,512.00
245	600995	南网储能	2023 年 7 月 10 日	11.01	2,600	28,626.00

246	600998	九州通	2023 年 7 月 3 日	10.38	12,367	128,369.46
247	601016	节能风电	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	3.67	39,300	144,231.00
248	601106	中国一重	2023 年 7 月 4 日	3.36	24,000	80,640.00
249	601118	海南橡胶	2023 年 7 月 10 日	4.48	17,000	76,160.00
250	601139	深圳燃气	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	7.29	2,000	14,580.00
251	601156	东航物流	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 5 日	13.00	4,800	62,400.00
252	601158	重庆水务	2023 年 7 月 5 日	5.56	5,000	27,800.00
253	601179	中国西电	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 12 日	5.41	19,800	107,118.00
254	601228	广州港	2023 年 7 月 5 日	3.23	9,200	29,716.00
255	601231	环旭电子	2023 年 7 月 10 日	14.96	5,900	88,264.00
256	601298	青岛港	2023 年 7 月 3 日	6.97	6,200	43,214.00
257	601456	国联证券	2023 年 7 月 12 日-2023 年 7 月 13 日	9.10	12,000	109,200.00
258	601568	北元集团	2023 年 7 月 3 日	5.27	10,500	55,335.00
259	601598	中国外运	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 11 日	4.66	7,200	33,552.00
260	601608	中信重工	2023 年 7 月 4 日	4.21	15,000	63,150.00
261	601611	中国核建	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 5 日	8.45	9,100	76,895.00
262	601636	旗滨集团	2023 年 7 月 5 日	8.62	7,200	62,064.00
263	601665	齐鲁银行	2023 年 7 月 5 日	3.92	22,000	86,240.00
264	601718	际华集团	2023 年 7 月 11 日	2.97	2,900	8,613.00
265	601778	晶科科技	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 12 日	4.94	16,600	82,004.00
266	601828	美凯龙	2023 年 7 月 10 日	4.79	6,600	31,614.00
267	601866	中远海发	2023 年 7 月 10 日	2.47	40,000	98,800.00
268	601869	长飞光纤	2023 年 7 月 3 日	37.01	1,000	37,010.00
269	601880	辽港股	2023 年 7 月 10 日-2023	1.56	77,800	121,368.0

		份	年 7 月 11 日			0
270	601928	凤凰传媒	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 5 日	11.40	7,700	87,780.00
271	601991	大唐发电	2023 年 7 月 13 日	3.31	37,000	122,470.00
272	601992	金隅集团	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 14 日	2.18	43,200	94,176.00
273	601997	贵阳银行	2023 年 7 月 12 日	5.16	4,300	22,188.00
274	603000	人民网	2023 年 7 月 4 日	29.20	4,900	143,080.00
275	603056	德邦股份	2023 年 7 月 3 日	15.42	2,700	41,634.00
276	603077	和邦生物	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 12 日	2.43	64,100	155,763.00
277	603127	昭衍新药	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	40.90	2,600	106,340.00
278	603218	日月股份	2023 年 7 月 3 日	18.99	4,300	81,657.00
279	603225	新凤鸣	2023 年 7 月 11 日-2023 年 7 月 12 日	11.05	6,000	66,300.00
280	603228	景旺电子	2023 年 7 月 10 日	25.65	3,400	87,210.00
281	603233	大参林	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	28.01	4,400	123,244.00
282	603338	浙江鼎力	2023 年 7 月 3 日	56.01	2,400	134,424.00
283	603355	莱克电气	2023 年 7 月 3 日	25.41	1,000	25,410.00
284	603379	三美股份	2023 年 7 月 3 日	23.51	2,000	47,020.00
285	603456	九洲药业	2023 年 7 月 11 日	27.38	4,400	120,472.00
286	603517	绝味食品	2023 年 7 月 3 日	37.15	3,000	111,450.00
287	603529	爱玛科技	2023 年 7 月 12 日	32.22	2,600	83,772.00
288	603596	伯特利	2023 年 7 月 10 日	79.26	2,100	166,446.00
289	603638	艾迪精密	2023 年 7 月 13 日	20.52	2,700	55,404.00
290	603650	彤程新材	2023 年 7 月 4 日	32.80	1,800	59,040.00
291	603688	石英股	2023 年 7 月 4 日	113.84	1,600	182,144.00

		份				0
292	603816	顾家家居	2023 年 7 月 3 日	38.15	4,300	164,045.00
293	603826	坤彩科技	2023 年 7 月 12 日	50.00	1,400	70,000.00
294	603866	桃李面包	2023 年 7 月 4 日	10.12	1,200	12,144.00
295	603927	中科软	2023 年 7 月 4 日	38.56	2,900	111,824.00
296	605358	立昂微	2023 年 7 月 11 日	36.73	1,600	58,768.00
297	688002	睿创微纳	2023 年 7 月 10 日	44.80	1,700	76,160.00
298	688006	杭可科技	2023 年 7 月 11 日	30.47	1,100	33,517.00
299	688009	中国通号	2023 年 7 月 10 日	5.80	23,000	133,400.00
300	688029	南微医学	2023 年 7 月 10 日	81.56	1,000	81,560.00
301	688107	安路科技	2023 年 7 月 4 日	55.39	1,200	66,468.00
302	688116	天奈科技	2023 年 7 月 11 日-2023 年 7 月 14 日	45.75	2,400	109,800.00
303	688208	道通科技	2023 年 7 月 13 日	30.31	2,300	69,713.00
304	688256	寒武纪-U	2023 年 7 月 13 日	188.00	1,600	300,800.00
305	688276	百克生物	2023 年 7 月 12 日	62.60	1,300	81,380.00
306	688289	圣湘生物	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	16.84	2,500	42,100.00
307	688385	复旦微电	2023 年 7 月 10 日	50.10	2,600	130,260.00
308	688390	固德威	2023 年 7 月 11 日	166.86	1,000	166,860.00
309	688521	芯原股份	2023 年 7 月 5 日	71.92	2,200	158,224.00
310	688567	孚能科技	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 12 日	21.59	8,800	189,992.00
311	688690	纳微科技	2023 年 7 月 13 日	38.85	1,300	50,505.00
312	688777	中控技术	2023 年 7 月 3 日	62.78	4,350	273,093.00
313	688778	厦钨新能	2023 年 7 月 11 日	49.50	1,700	84,150.00

314	688779	长远锂科	2023 年 7 月 14 日	11.27	9,300	104,811.00
315	689009	九号公司-WD	2023 年 7 月 10 日	36.85	4,300	158,455.00
合计	-	-	-	-	3,591,817	37,214,134.46

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(包含中小板，创业板及其他经中国证监会核准的股票，存托凭证)，债券(含国债，地方政府债，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，次级债，可转换债券，可交换债券等)，货币市场工具，同业存单，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)。本基金可依据法律法规的规定，参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国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，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 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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（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%。

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	11,714,543.40	-	-	-	11,714,543.40
结算备付金	8,617,168.83	-	-	-	8,617,168.83
存出保证金	2,033,426.32	-	-	-	2,033,426.32
交易性金融资产	-	-	-	-393,369,141.19	393,369,141.19
应收股利	-	-	-	34,431.23	34,431.23
应收清算款	-	-	-	248,267.41	248,267.41
其他资产	-	-	-	17,518.43	17,518.43
资产总计	22,365,138.55	-	-	-393,669,358.26	416,034,496.81
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	51,328.68	51,328.68
应付托管费	-	-	-	17,109.54	17,109.54
应交税费	-	-	-	3,117.71	3,117.71
其他负债	-	-	-	250,010.14	250,010.14
负债总计	-	-	-	321,566.07	321,566.07
利率敏感度缺口	22,365,138.55	-	-	-393,347,792.19	415,712,930.74
上年度末 2022年12月31日					
资产					
银行存款	9,213,589.85	-	-	-	9,213,589.85
结算备付金	8,550,735.13	-	-	-	8,550,735.13
存出保证金	1,915,009.33	-	-	-	1,915,009.33
交易性金融资产	-	-	-	-332,510,595.62	332,510,595.62
应收股利	-	-	-	1,485.00	1,485.00
应收清算款	-	-	-	217,033.45	217,033.45

其他资产	-	-	-	10,632.64	10,632.64
资产总计	19,679,334.31	-	-	-332,739,746.71	352,419,081.02
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	46,139.47	46,139.47
应付托管费	-	-	-	15,379.84	15,379.84
应交税费	-	-	-	1,603.98	1,603.98
其他负债	-	-	-	689,504.70	689,504.70
负债总计	-	-	-	752,627.99	752,627.99
利率敏感度缺口	19,679,334.31	-	-	-331,987,118.72	351,666,453.03

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。

基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股和备选成份股(含存托凭证)的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。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 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	393,369,141.19	94.63	332,510,595.62	94.55
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	393,369,141.19	94.63	332,510,595.62	94.55

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(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%	20,278,476.76	17,222,864.54
	业绩比较基准下降	-20,278,476.76	-17,222,864.54

	5%		
--	----	--	--

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	391,729,294.23
第二层次	837,400.45
第三层次	802,446.51
合计	393,369,141.19

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	393,369,141.19	94.55
	其中：股票	393,369,141.19	94.55
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	20,331,712.23	4.89
8	其他各项资产	2,333,643.39	0.56
9	合计	416,034,496.81	100.00

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

2、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 37,214,134.46 元，占基金资产净值比为 8.95%。

3、报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：913,880.00 元，占净值比 0.22%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,745,884.00	0.66
B	采矿业	14,442,187.10	3.47
C	制造业	245,565,756.81	59.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,522,332.60	3.25

E	建筑业	4,358,366.00	1.05
F	批发和零售业	12,379,718.42	2.98
G	交通运输、仓储和邮政业	5,903,394.76	1.42
H	住宿和餐饮业	733,573.45	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,141,016.25	7.73
J	金融业	33,589,459.57	8.08
K	房地产业	5,315,920.00	1.28
L	租赁和商务服务业	4,810,978.00	1.16
M	科学研究和技术服务业	4,406,288.00	1.06
N	水利、环境和公共设施管理业	2,181,717.26	0.52
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,956,257.00	0.47
R	文化、体育和娱乐业	5,537,808.00	1.33
S	综合	2,064,807.00	0.50
	合计	391,655,464.22	94.21

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,273,213.89	0.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	5,955.43	0.00
F	批发和零售业	37,499.68	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	275,202.93	0.07
J	金融业	-	-
K	房地产业	31,515.00	0.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	33,416.57	0.01
N	水利、环境和公共	-	-

	设施管理业		
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	21,426.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,713,676.97	0.41

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	300308	中际旭创	37,000	5,455,650.00	1.31
2	688256	寒武纪-U	12,000	2,256,000.00	0.54
3	000988	华工科技	58,000	2,204,580.00	0.53
4	002340	格林美	296,400	2,048,124.00	0.49
5	002384	东山精密	78,900	2,043,510.00	0.49
6	002422	科伦药业	67,900	2,015,272.00	0.48
7	600372	中航电子	129,400	1,964,292.00	0.47
8	300418	昆仑万维	48,300	1,945,524.00	0.47
9	300012	华测检测	97,100	1,893,450.00	0.46
10	600157	永泰能源	1,282,600	1,821,292.00	0.44
11	300724	捷佳伟创	16,100	1,808,835.00	0.44
12	600079	人福医药	65,900	1,775,346.00	0.43
13	600489	中金黄金	167,900	1,734,407.00	0.42
14	300003	乐普医疗	76,000	1,718,360.00	0.41
15	688777	中控技术	27,257	1,711,194.46	0.41
16	002738	中矿资源	32,940	1,677,963.60	0.40
17	600487	亨通光电	113,900	1,669,774.00	0.40
18	002028	思源电气	35,300	1,649,216.00	0.40
19	600536	中国软件	34,702	1,626,829.76	0.39
20	601058	赛轮轮胎	141,400	1,610,546.00	0.39
21	002463	沪电股份	76,900	1,610,286.00	0.39
22	601555	东吴证券	231,190	1,604,458.60	0.39
23	600765	中航重机	59,460	1,576,284.60	0.38
24	300037	新宙邦	30,060	1,559,813.40	0.38
25	000066	中国长城	111,700	1,544,811.00	0.37
26	600885	宏发股份	48,120	1,532,622.00	0.37

27	000807	云铝股份	120,100	1,528,873.00	0.37
28	600482	中国动力	62,300	1,460,312.00	0.35
29	000009	中国宝安	119,100	1,437,537.00	0.35
30	688099	晶晨股份	16,800	1,416,576.00	0.34
31	300146	汤臣倍健	58,900	1,412,422.00	0.34
32	000423	东阿阿胶	26,400	1,411,080.00	0.34
33	600352	浙江龙盛	150,200	1,404,370.00	0.34
34	300058	蓝色光标	143,800	1,390,546.00	0.33
35	002966	苏州银行	211,680	1,386,504.00	0.33
36	002156	通富微电	61,100	1,380,860.00	0.33
37	002185	华天科技	148,000	1,361,600.00	0.33
38	601108	财通证券	187,600	1,358,224.00	0.33
39	600415	小商品城	158,300	1,350,299.00	0.32
40	002625	光启技术	87,000	1,327,620.00	0.32
41	002624	完美世界	78,400	1,324,176.00	0.32
42	600027	华电国际	196,500	1,314,585.00	0.32
43	300144	宋城演艺	105,600	1,309,440.00	0.31
44	600109	国金证券	150,500	1,304,835.00	0.31
45	000783	长江证券	223,400	1,295,720.00	0.31
46	600988	赤峰黄金	96,000	1,292,160.00	0.31
47	601233	桐昆股份	97,400	1,290,550.00	0.31
48	600161	天坛生物	47,500	1,289,625.00	0.31
49	601077	渝农商行	357,400	1,283,066.00	0.31
50	600298	安琪酵母	35,100	1,270,971.00	0.31
51	002008	大族激光	48,500	1,270,700.00	0.31
52	300568	星源材质	73,900	1,270,341.00	0.31
53	600418	江淮汽车	100,800	1,269,072.00	0.31
54	300285	国瓷材料	46,300	1,268,620.00	0.31
55	600096	云天化	74,100	1,264,887.00	0.30
56	002385	大北农	191,100	1,261,260.00	0.30
57	002223	鱼跃医疗	34,700	1,248,853.00	0.30
58	000630	铜陵有色	425,400	1,229,406.00	0.30
59	603444	吉比特	2,500	1,227,775.00	0.30
60	002407	多氟多	61,800	1,227,348.00	0.30
61	600862	中航高科	48,230	1,220,701.30	0.29
62	603882	金城医学	16,100	1,215,550.00	0.29
63	300390	天华新能	33,750	1,208,250.00	0.29
64	002409	雅克科技	16,500	1,202,520.00	0.29
65	601162	天风证券	400,200	1,192,596.00	0.29
66	300024	机器人	71,500	1,191,905.00	0.29
67	603688	石英股份	10,400	1,183,936.00	0.28
68	002497	雅化集团	66,500	1,182,370.00	0.28
69	000933	神火股份	90,900	1,181,700.00	0.28

70	300474	景嘉微	13,100	1,178,869.00	0.28
71	300073	当升科技	23,400	1,177,722.00	0.28
72	002240	盛新锂能	36,800	1,172,816.00	0.28
73	600705	中航产融	305,800	1,171,214.00	0.28
74	300395	菲利华	23,800	1,170,960.00	0.28
75	300604	长川科技	24,500	1,163,505.00	0.28
76	601168	西部矿业	110,000	1,156,100.00	0.28
77	605358	立昂微	31,200	1,145,976.00	0.28
78	002439	启明星辰	38,400	1,142,784.00	0.27
79	000932	华菱钢铁	239,300	1,141,461.00	0.27
80	603596	伯特利	14,300	1,133,418.00	0.27
81	600066	宇通客车	76,600	1,129,084.00	0.27
82	000975	银泰黄金	96,160	1,125,072.00	0.27
83	002600	领益智造	162,500	1,122,875.00	0.27
84	300136	信维通信	55,800	1,120,464.00	0.27
85	600060	海信视像	45,200	1,118,700.00	0.27
86	002138	顺络电子	46,500	1,111,815.00	0.27
87	002797	第一创业	194,000	1,109,680.00	0.27
88	002568	百润股份	30,300	1,101,405.00	0.26
89	002465	海格通信	106,400	1,100,176.00	0.26
90	603816	顾家家居	28,400	1,083,460.00	0.26
91	000021	深科技	54,000	1,079,460.00	0.26
92	601128	常熟银行	158,200	1,078,924.00	0.26
93	603939	益丰药房	29,100	1,076,700.00	0.26
94	600839	四川长虹	213,200	1,076,660.00	0.26
95	600160	巨化股份	77,900	1,073,462.00	0.26
96	300253	卫宁健康	99,100	1,072,262.00	0.26
97	002850	科达利	8,100	1,071,225.00	0.26
98	600563	法拉电子	7,800	1,070,940.00	0.26
99	000591	太阳能	157,900	1,070,562.00	0.26
100	300832	新产业	18,100	1,067,900.00	0.26
101	600879	航天电子	125,500	1,065,495.00	0.26
102	688567	孚能科技	49,200	1,062,228.00	0.26
103	600873	梅花生物	118,900	1,061,777.00	0.26
104	000683	远兴能源	146,300	1,051,897.00	0.25
105	601990	南京证券	127,600	1,043,768.00	0.25
106	600392	盛和资源	80,900	1,041,183.00	0.25
107	002368	太极股份	25,179	1,036,619.43	0.25
108	688521	芯原股份	14,400	1,035,648.00	0.25
109	002078	太阳纸业	96,800	1,034,792.00	0.25
110	300699	光威复材	33,520	1,034,092.00	0.25
111	600497	驰宏锌锗	205,700	1,032,614.00	0.25
112	603589	口子窖	20,800	1,026,480.00	0.25

113	688169	石头科技	3,200	1,026,176.00	0.25
114	601696	中银证券	96,200	1,025,492.00	0.25
115	300866	安克创新	11,700	1,023,750.00	0.25
116	000729	燕京啤酒	81,300	1,013,811.00	0.24
117	600177	雅戈尔	160,300	1,011,493.00	0.24
118	300118	东方日升	39,400	1,009,822.00	0.24
119	600516	方大炭素	162,700	1,008,740.00	0.24
120	002025	航天电器	15,800	1,008,040.00	0.24
121	000831	中国稀土	33,900	1,003,440.00	0.24
122	002294	信立泰	32,100	1,001,199.00	0.24
123	300017	网宿科技	140,700	1,000,377.00	0.24
124	600141	兴发集团	44,900	997,678.00	0.24
125	600642	申能股份	141,700	990,483.00	0.24
126	688390	固德威	5,908	985,808.88	0.24
127	000728	国元证券	151,100	985,172.00	0.24
128	002673	西部证券	154,800	982,980.00	0.24
129	002430	杭氧股份	28,400	975,824.00	0.23
130	600699	均胜电子	55,200	973,728.00	0.23
131	000629	钒钛股份	248,300	970,853.00	0.23
132	600170	上海建工	359,100	965,979.00	0.23
133	002532	天山铝业	161,100	964,989.00	0.23
134	600325	华发股份	97,700	962,345.00	0.23
135	600118	中国卫星	34,100	961,961.00	0.23
136	002273	水晶光电	80,200	957,588.00	0.23
137	002195	二三四五	330,500	955,145.00	0.23
138	002268	电科网安	34,100	950,367.00	0.23
139	601966	玲珑轮胎	42,600	946,572.00	0.23
140	600153	建发股份	86,700	945,897.00	0.23
141	002739	万达电影	75,400	945,516.00	0.23
142	600521	华海药业	51,300	944,433.00	0.23
143	600486	扬农化工	10,800	944,136.00	0.23
144	002372	伟星新材	45,900	942,786.00	0.23
145	600166	福田汽车	277,200	942,480.00	0.23
146	000400	许继电气	40,700	938,135.00	0.23
147	600143	金发科技	107,300	936,729.00	0.23
148	600549	厦门钨业	49,100	934,373.00	0.22
149	000998	隆平高科	60,800	933,280.00	0.22
150	300595	欧普康视	30,900	932,871.00	0.22
151	603000	人民网	31,900	931,480.00	0.22
152	600399	抚顺特钢	91,000	928,200.00	0.22
153	688002	睿创微纳	20,683	926,598.40	0.22
154	000738	航发控制	37,900	924,760.00	0.22
155	600637	东方明珠	118,200	924,324.00	0.22

156	002065	东华软件	129,500	914,270.00	0.22
157	689009	九号公司-WD	24,800	913,880.00	0.22
158	002444	巨星科技	41,645	911,192.60	0.22
159	600859	王府井	45,800	906,382.00	0.22
160	300487	蓝晓科技	14,500	905,090.00	0.22
161	688220	翱捷科技-U	12,000	904,680.00	0.22
162	600481	双良节能	64,700	904,506.00	0.22
163	601577	长沙银行	116,000	900,160.00	0.22
164	000997	新大陆	47,600	899,640.00	0.22
165	601198	东兴证券	111,900	897,438.00	0.22
166	002131	利欧股份	389,900	896,770.00	0.22
167	688072	拓荆科技	2,100	894,537.00	0.22
168	600499	科达制造	78,702	894,054.72	0.22
169	688536	思瑞浦	4,100	893,800.00	0.22
170	300438	鹏辉能源	18,600	893,544.00	0.21
171	300383	光环新网	83,000	892,250.00	0.21
172	002353	杰瑞股份	35,500	892,115.00	0.21
173	600704	物产中大	179,900	888,706.00	0.21
174	000960	锡业股份	57,000	886,350.00	0.21
175	300682	朗新科技	37,900	882,312.00	0.21
176	600271	航天信息	64,100	877,529.00	0.21
177	600021	上海电力	81,300	875,601.00	0.21
178	300001	特锐德	42,000	872,760.00	0.21
179	000519	中兵红箭	48,200	871,938.00	0.21
180	601997	贵阳银行	168,800	871,008.00	0.21
181	002373	千方科技	63,800	870,232.00	0.21
182	603077	和邦生物	356,800	867,024.00	0.21
183	688009	中国通号	149,300	865,940.00	0.21
184	000623	吉林敖东	53,700	861,348.00	0.21
185	000703	恒逸石化	127,000	861,060.00	0.21
186	300676	华大基因	14,300	857,857.00	0.21
187	300088	长信科技	141,634	854,053.02	0.21
188	002056	横店东磁	46,900	854,049.00	0.21
189	002507	涪陵榨菜	46,540	852,147.40	0.20
190	600380	健康元	66,800	849,028.00	0.20
191	600511	国药股份	21,800	846,930.00	0.20
192	000513	丽珠集团	21,600	840,456.00	0.20
193	600867	通化东宝	80,500	840,420.00	0.20
194	002152	广电运通	71,600	839,152.00	0.20
195	002281	光迅科技	22,600	838,234.00	0.20
196	600498	烽火通信	41,100	837,207.00	0.20
197	688301	奕瑞科技	2,960	835,992.80	0.20
198	600998	九州通	80,460	835,174.80	0.20

199	600529	山东药玻	30,600	832,932.00	0.20
200	688516	奥特维	4,400	828,960.00	0.20
201	600546	山煤国际	57,200	827,684.00	0.20
202	002203	海亮股份	68,800	826,288.00	0.20
203	002299	圣农发展	43,000	823,450.00	0.20
204	600348	华阳股份	104,050	823,035.50	0.20
205	601016	节能风电	224,220	822,887.40	0.20
206	000636	风华高科	53,400	819,156.00	0.20
207	603338	浙江鼎力	14,600	817,746.00	0.20
208	600739	辽宁成大	61,800	812,670.00	0.20
209	002595	豪迈科技	23,100	811,503.00	0.20
210	603517	绝味食品	21,800	809,870.00	0.19
211	603712	七一二	26,709	806,878.89	0.19
212	002192	融捷股份	12,000	801,960.00	0.19
213	601636	旗滨集团	92,900	800,798.00	0.19
214	603737	三棵树	12,180	796,815.60	0.19
215	002080	中材科技	38,700	794,124.00	0.19
216	603927	中科软	20,540	792,022.40	0.19
217	002531	天顺风能	52,000	791,960.00	0.19
218	002506	协鑫集成	270,200	791,686.00	0.19
219	603885	吉祥航空	51,100	788,473.00	0.19
220	002432	九安医疗	22,300	785,183.00	0.19
221	600863	内蒙华电	188,400	781,860.00	0.19
222	688772	珠海冠宇	38,700	779,805.00	0.19
223	600970	中材国际	61,000	777,750.00	0.19
224	600580	卧龙电驱	53,100	775,791.00	0.19
225	600655	豫园股份	112,500	771,750.00	0.19
226	688385	复旦微电	15,400	771,540.00	0.19
227	002092	中泰化学	119,600	771,420.00	0.19
228	300182	捷成股份	121,700	767,927.00	0.18
229	000878	云南铜业	69,400	766,870.00	0.18
230	300212	易华录	23,000	764,290.00	0.18
231	600820	隧道股份	127,000	763,270.00	0.18
232	300296	利亚德	116,800	762,704.00	0.18
233	002683	广东宏大	25,900	762,496.00	0.18
234	600528	中铁工业	76,900	759,772.00	0.18
235	600909	华安证券	162,640	759,528.80	0.18
236	002939	长城证券	93,100	756,903.00	0.18
237	002926	华西证券	90,900	755,379.00	0.18
238	600535	天士力	51,900	753,069.00	0.18
239	300244	迪安诊断	28,900	740,707.00	0.18
240	600329	达仁堂	16,500	740,685.00	0.18
241	300748	金力永磁	24,700	739,024.00	0.18

242	000547	航天发展	73,800	738,000.00	0.18
243	000750	国海证券	220,000	737,000.00	0.18
244	603233	大参林	26,292	736,438.92	0.18
245	000893	亚钾国际	32,100	736,374.00	0.18
246	603160	汇顶科技	15,900	735,375.00	0.18
247	600258	首旅酒店	38,711	733,573.45	0.18
248	000039	中集集团	106,300	732,407.00	0.18
249	600008	首创环保	254,200	732,096.00	0.18
250	002557	洽洽食品	17,600	731,280.00	0.18
251	600416	湘电股份	38,200	729,238.00	0.18
252	603156	养元饮品	29,200	721,240.00	0.17
253	000970	中科三环	56,075	718,881.50	0.17
254	002429	兆驰股份	130,600	718,300.00	0.17
255	000060	中金岭南	151,000	717,250.00	0.17
256	601991	大唐发电	214,600	710,326.00	0.17
257	603456	九洲药业	25,900	709,142.00	0.17
258	603893	瑞芯微	9,700	706,645.00	0.17
259	688200	华峰测控	4,600	703,800.00	0.17
260	000830	鲁西化工	66,500	702,240.00	0.17
261	600369	西南证券	191,800	700,070.00	0.17
262	603658	安图生物	13,500	698,355.00	0.17
263	600390	五矿资本	129,800	698,324.00	0.17
264	300558	贝达药业	14,500	696,435.00	0.17
265	600435	北方导航	60,500	695,145.00	0.17
266	002500	山西证券	124,320	693,705.60	0.17
267	002508	老板电器	27,400	692,946.00	0.17
268	600398	海澜之家	99,700	685,936.00	0.17
269	002128	电投能源	51,700	683,474.00	0.16
270	002936	郑州银行	296,861	682,780.30	0.16
271	601880	辽港股份	434,800	678,288.00	0.16
272	600038	中直股份	17,000	676,940.00	0.16
273	300009	安科生物	67,592	675,920.00	0.16
274	300070	碧水源	125,500	672,680.00	0.16
275	601717	郑煤机	53,300	663,585.00	0.16
276	002153	石基信息	47,242	661,388.00	0.16
277	600848	上海临港	55,200	659,640.00	0.16
278	600985	淮北矿业	57,200	658,944.00	0.16
279	300026	红日药业	121,400	657,988.00	0.16
280	603858	步长制药	31,900	656,821.00	0.16
281	000050	深天马 A	70,900	650,862.00	0.16
282	300529	健帆生物	27,900	646,722.00	0.16
283	002572	索菲亚	36,800	641,056.00	0.15
284	601179	中国西电	118,300	640,003.00	0.15

285	603127	昭衍新药	15,600	638,040.00	0.15
286	002244	滨江集团	71,800	633,276.00	0.15
287	300373	扬杰科技	15,600	632,892.00	0.15
288	600673	东阳光	87,000	627,270.00	0.15
289	601456	国联证券	68,900	626,990.00	0.15
290	002408	齐翔腾达	98,400	626,808.00	0.15
291	688188	柏楚电子	3,320	626,019.20	0.15
292	688779	长远锂科	55,500	625,485.00	0.15
293	002266	浙富控股	151,300	624,869.00	0.15
294	003035	南网能源	87,400	622,288.00	0.15
295	600895	张江高科	44,700	622,224.00	0.15
296	601958	金钼股份	55,800	622,170.00	0.15
297	002019	亿帆医药	42,400	619,040.00	0.15
298	600827	百联股份	46,300	619,031.00	0.15
299	600566	济川药业	21,300	618,552.00	0.15
300	600667	太极实业	85,100	617,826.00	0.15
301	000155	川能动力	42,600	613,440.00	0.15
302	688538	和辉光电-U	240,500	610,870.00	0.15
303	002958	青农商行	224,500	610,640.00	0.15
304	600208	新潮中宝	245,600	609,088.00	0.15
305	300357	我武生物	18,100	608,703.00	0.15
306	688116	天奈科技	13,300	608,475.00	0.15
307	603267	鸿远电子	9,300	607,290.00	0.15
308	601666	平煤股份	80,100	603,954.00	0.15
309	601000	唐山港	171,000	603,630.00	0.15
310	000739	普洛药业	34,000	603,160.00	0.15
311	600282	南钢股份	177,900	599,523.00	0.14
312	600171	上海贝岭	32,800	598,600.00	0.14
313	000887	中鼎股份	45,600	596,904.00	0.14
314	600755	厦门国贸	76,900	595,206.00	0.14
315	600378	昊华科技	15,800	594,712.00	0.14
316	002155	湖南黄金	48,553	592,346.60	0.14
317	002670	国盛金控	67,000	588,260.00	0.14
318	600959	江苏有线	173,200	585,416.00	0.14
319	300677	英科医疗	26,600	585,200.00	0.14
320	600316	洪都航空	24,800	581,560.00	0.14
321	300115	长盈精密	48,480	577,396.80	0.14
322	601231	环旭电子	38,200	571,472.00	0.14
323	300888	稳健医疗	13,680	570,045.60	0.14
324	600315	上海家化	19,600	568,596.00	0.14
325	002487	大金重工	18,400	567,456.00	0.14
326	002030	达安基因	56,696	565,259.12	0.14
327	601866	中远海发	228,500	564,395.00	0.14

328	600517	国网英大	99,000	564,300.00	0.14
329	603218	日月股份	29,700	564,003.00	0.14
330	000778	新兴铸管	138,200	563,856.00	0.14
331	000598	兴蓉环境	103,400	561,462.00	0.14
332	600056	中国医药	43,100	559,438.00	0.13
333	600131	国网信通	27,700	559,263.00	0.13
334	300363	博腾股份	18,900	559,251.00	0.13
335	600582	天地科技	95,500	556,765.00	0.13
336	000987	越秀资本	86,875	551,656.25	0.13
337	603026	胜华新材	9,300	551,025.00	0.13
338	002221	东华能源	63,600	550,140.00	0.13
339	002249	大洋电机	96,300	548,910.00	0.13
340	300251	光线传媒	67,700	547,693.00	0.13
341	600598	北大荒	41,000	546,530.00	0.13
342	000027	深圳能源	82,380	542,884.20	0.13
343	601005	重庆钢铁	387,000	541,800.00	0.13
344	002326	永太科技	35,400	541,266.00	0.13
345	688082	盛美上海	4,900	540,960.00	0.13
346	000709	河钢股份	238,700	539,462.00	0.13
347	600906	财达证券	74,900	539,280.00	0.13
348	002518	科士达	13,400	536,134.00	0.13
349	002183	怡亚通	104,900	534,990.00	0.13
350	601106	中国一重	158,300	531,888.00	0.13
351	601992	金隅集团	240,700	524,726.00	0.13
352	002831	裕同科技	21,500	524,385.00	0.13
353	002690	美亚光电	20,360	524,270.00	0.13
354	600718	东软集团	49,000	522,340.00	0.13
355	600373	中文传媒	39,100	520,812.00	0.13
356	000883	湖北能源	113,700	518,472.00	0.12
357	601665	齐鲁银行	132,200	518,224.00	0.12
358	002511	中顺洁柔	46,200	515,130.00	0.12
359	603568	伟明环保	29,326	513,498.26	0.12
360	300776	帝尔激光	7,900	512,710.00	0.12
361	000825	太钢不锈	132,300	512,001.00	0.12
362	601778	晶科科技	103,000	508,820.00	0.12
363	002985	北摩高科	11,482	506,585.84	0.12
364	603883	老百姓	16,862	503,330.70	0.12
365	601928	凤凰传媒	44,000	501,600.00	0.12
366	600663	陆家嘴	50,800	501,396.00	0.12
367	603228	景旺电子	19,520	500,688.00	0.12
368	600737	中粮糖业	61,700	496,685.00	0.12
369	600967	内蒙一机	49,100	495,910.00	0.12
370	603225	新凤鸣	44,100	487,305.00	0.12

371	600155	华创云信	78,301	487,032.22	0.12
372	600297	广汇汽车	234,100	486,928.00	0.12
373	688281	华秦科技	2,400	486,000.00	0.12
374	600801	华新水泥	39,300	485,355.00	0.12
375	300861	美畅股份	11,100	481,407.00	0.12
376	601098	中南传媒	41,400	480,240.00	0.12
377	603529	爱玛科技	14,900	480,078.00	0.12
378	002791	坚朗五金	7,400	478,854.00	0.12
379	002468	申通快递	44,163	477,843.66	0.11
380	300482	万孚生物	17,900	476,677.00	0.11
381	688208	道通科技	15,700	475,867.00	0.11
382	688778	厦钨新能	9,600	475,200.00	0.11
383	002745	木林森	51,400	472,880.00	0.11
384	000012	南玻 A	79,200	472,032.00	0.11
385	001227	兰州银行	164,400	470,184.00	0.11
386	603866	桃李面包	46,144	466,977.28	0.11
387	600871	石化油服	235,000	465,300.00	0.11
388	002032	苏泊尔	9,300	465,000.00	0.11
389	000156	华数传媒	53,400	464,580.00	0.11
390	600500	中化国际	82,900	460,924.00	0.11
391	000581	威孚高科	28,900	455,175.00	0.11
392	000401	冀东水泥	61,300	451,781.00	0.11
393	688690	纳微科技	11,600	450,660.00	0.11
394	002867	周大生	25,300	449,834.00	0.11
395	002250	联化科技	42,600	445,596.00	0.11
396	688276	百克生物	7,100	444,460.00	0.11
397	600556	天下秀	62,600	443,834.00	0.11
398	688029	南微医学	5,440	443,686.40	0.11
399	301029	怡合达	9,920	443,225.60	0.11
400	601118	海南橡胶	98,800	442,624.00	0.11
401	601611	中国核建	52,200	441,090.00	0.11
402	600022	山东钢铁	308,800	438,496.00	0.11
403	000930	中粮科技	53,800	435,780.00	0.10
404	688520	神州细胞-U	7,600	431,224.00	0.10
405	000785	居然之家	113,000	430,530.00	0.10
406	002010	传化智联	80,900	430,388.00	0.10
407	300850	新强联	11,400	426,132.00	0.10
408	002423	中粮资本	53,200	425,600.00	0.10
409	601598	中国外运	91,000	424,060.00	0.10
410	600259	广晟有色	11,700	422,838.00	0.10
411	601608	中信重工	100,200	421,842.00	0.10
412	688006	杭可科技	13,840	421,704.80	0.10
413	600062	华润双鹤	24,100	419,822.00	0.10

414	002505	鹏都农牧	220,800	417,312.00	0.10
415	000559	万向钱潮	76,200	415,290.00	0.10
416	002081	金螳螂	91,900	414,469.00	0.10
417	600597	光明乳业	39,700	412,880.00	0.10
418	000089	深圳机场	59,100	410,745.00	0.10
419	600782	新钢股份	110,400	409,584.00	0.10
420	300618	寒锐钴业	12,500	405,125.00	0.10
421	603826	坤彩科技	8,100	405,000.00	0.10
422	000958	电投产融	93,200	403,556.00	0.10
423	600901	江苏金租	96,460	398,379.80	0.10
424	603638	艾迪精密	19,380	397,677.60	0.10
425	600707	彩虹股份	82,800	394,128.00	0.09
426	600339	中油工程	96,600	393,162.00	0.09
427	000937	冀中能源	61,200	390,456.00	0.09
428	600409	三友化工	71,500	389,675.00	0.09
429	600095	湘财股份	49,500	386,100.00	0.09
430	000898	鞍钢股份	138,300	384,474.00	0.09
431	688107	安路科技	6,900	382,191.00	0.09
432	601187	厦门银行	76,100	382,022.00	0.09
433	688052	纳芯微	2,400	380,088.00	0.09
434	603707	健友股份	28,017	378,229.50	0.09
435	002761	浙江建投	24,900	377,982.00	0.09
436	601718	际华集团	126,700	376,299.00	0.09
437	000537	广宇发展	32,200	375,774.00	0.09
438	000415	渤海租赁	178,500	374,850.00	0.09
439	600507	方大特钢	80,771	373,969.73	0.09
440	000967	盈峰环境	73,400	370,670.00	0.09
441	001914	招商积余	24,500	368,725.00	0.09
442	600167	联美控股	52,800	368,016.00	0.09
443	688234	天岳先进	4,900	362,306.00	0.09
444	601568	北元集团	68,740	362,259.80	0.09
445	600968	海油发展	117,300	360,111.00	0.09
446	000563	陕国投 A	118,000	359,900.00	0.09
447	600808	马钢股份	139,400	358,258.00	0.09
448	601156	东航物流	27,500	357,500.00	0.09
449	002925	盈趣科技	18,100	351,140.00	0.08
450	300257	开山股份	22,900	347,393.00	0.08
451	002705	新宝股份	19,100	344,373.00	0.08
452	600195	中牧股份	29,480	344,326.40	0.08
453	600126	杭钢股份	77,900	338,086.00	0.08
454	603650	彤程新材	10,300	337,840.00	0.08
455	600764	中国海防	12,300	334,806.00	0.08
456	300442	润泽科技	10,860	334,053.60	0.08

457	603379	三美股份	14,140	332,431.40	0.08
458	002608	江苏国信	43,600	330,052.00	0.08
459	688185	康希诺	4,000	326,000.00	0.08
460	000959	首钢股份	90,200	315,700.00	0.08
461	000402	金融街	69,000	311,880.00	0.08
462	603786	科博达	4,600	302,220.00	0.07
463	002653	海思科	12,800	302,080.00	0.07
464	601828	美凯龙	62,500	299,375.00	0.07
465	002110	三钢闽光	70,700	298,354.00	0.07
466	688819	天能股份	8,000	294,720.00	0.07
467	001203	大中矿业	26,100	289,971.00	0.07
468	002563	森马服饰	46,600	289,852.00	0.07
469	688289	圣湘生物	17,008	286,414.72	0.07
470	601298	青岛港	40,400	281,588.00	0.07
471	601228	广州港	87,100	281,333.00	0.07
472	600377	宁沪高速	28,600	281,138.00	0.07
473	603056	德邦股份	17,805	274,553.10	0.07
474	600927	永安期货	16,800	273,168.00	0.07
475	600623	华谊集团	43,600	271,628.00	0.07
476	000031	大悦城	74,200	271,572.00	0.07
477	600928	西安银行	76,900	270,688.00	0.07
478	603317	天味食品	18,431	269,276.91	0.06
479	601869	长飞光纤	7,100	262,771.00	0.06
480	600350	山东高速	39,000	248,430.00	0.06
481	002399	海普瑞	21,600	247,752.00	0.06
482	601136	首创证券	17,300	245,141.00	0.06
483	000869	张裕 A	7,900	242,214.00	0.06
484	601139	深圳燃气	33,200	242,028.00	0.06
485	601969	海南矿业	35,200	231,616.00	0.06
486	001872	招商港口	13,400	231,418.00	0.06
487	600995	南网储能	20,200	222,402.00	0.05
488	002945	华林证券	15,600	213,408.00	0.05
489	000553	安道麦 A	25,100	211,844.00	0.05
490	688105	诺唯赞	6,900	210,381.00	0.05
491	600299	安迪苏	23,200	184,904.00	0.04
492	601158	重庆水务	33,200	184,592.00	0.04
493	688248	南网科技	4,800	184,272.00	0.04
494	603868	飞科电器	2,800	176,652.00	0.04
495	603355	莱克电气	6,700	170,247.00	0.04
496	688295	中复神鹰	4,600	168,728.00	0.04
497	600032	浙江新能	12,500	157,000.00	0.04
498	600956	新天绿能	17,600	153,472.00	0.04
499	300741	华宝股份	7,100	152,082.00	0.04

500	002901	大博医疗	3,400	105,672.00	0.03
-----	--------	------	-------	------------	------

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	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.03
2	301486	致尚科技	2,278	131,349.48	0.03
3	688543	国科军工	2,286	127,649.00	0.03
4	301292	海科新源	5,707	114,082.93	0.03
5	301488	豪恩汽电	2,244	89,266.32	0.02
6	688631	莱斯信息	2,376	76,722.34	0.02
7	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
8	301202	朗威股份	2,821	72,838.22	0.02
9	301261	恒工精密	1,945	71,770.50	0.02
10	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
11	688249	晶合集成	1,765	31,875.90	0.01
12	000540	*ST 中天	286,500	31,515.00	0.01
13	301301	川宁生物	2,922	26,181.12	0.01
14	688472	阿特斯	1,489	25,372.56	0.01
15	688361	中科飞测-U	376	24,315.92	0.01
16	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.01
17	301293	三博脑科	300	21,426.00	0.01
18	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
19	301325	曼恩斯特	164	17,703.80	0.00
20	688469	中芯集成-U	3,257	17,620.37	0.00
21	688443	智翔金泰-U	572	16,868.28	0.00
22	301358	湖南裕能	378	16,212.42	0.00
23	688478	晶升股份	382	16,185.34	0.00
24	688562	航天软件	674	15,036.94	0.00
25	301399	英特科技	281	14,491.17	0.00
26	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
27	688531	日联科技	104	14,140.88	0.00
28	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
29	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
30	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
31	301303	真兰仪表	587	13,101.84	0.00
32	688146	中船特气	327	12,468.51	0.00
33	688458	美芯晟	137	12,434.12	0.00
34	301408	华人健康	732	12,407.40	0.00
35	688582	芯动联科	304	12,366.72	0.00
36	301291	明阳电气	393	12,194.79	0.00
37	301360	荣旗科技	131	12,130.60	0.00
38	301382	蜂助手	369	12,117.96	0.00
39	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00

40	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
41	688581	安杰思	92	10,858.76	0.00
42	688570	天玛智控	427	10,815.91	0.00
43	688352	颀中科技	894	10,790.58	0.00
44	688334	西高院	652	10,568.92	0.00
45	688620	安凯微	823	10,155.82	0.00
46	301332	德尔玛	735	10,091.55	0.00
47	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
48	001287	中电港	444	9,332.88	0.00
49	301262	海看股份	365	9,307.50	0.00
50	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
51	688507	索辰科技	73	8,914.03	0.00
52	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
53	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
54	688433	华曙高科	269	8,473.50	0.00
55	301357	北方长龙	171	8,274.69	0.00
56	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
57	301376	致欧科技	360	8,103.60	0.00
58	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
59	301386	未来电器	330	7,850.70	0.00
60	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
61	601061	中信金属	1,010	7,655.80	0.00
62	301322	绿通科技	143	7,613.32	0.00
63	301439	泓淋电力	443	7,486.70	0.00
64	301170	锡南科技	213	7,440.09	0.00
65	301281	科源制药	295	7,404.50	0.00
66	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
67	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
68	688479	友车科技	211	6,222.39	0.00
69	603135	中重科技	335	5,993.15	0.00
70	301345	涛涛车业	126	5,876.64	0.00
71	601065	江盐集团	331	3,919.04	0.00
72	601133	柏诚股份	292	3,579.92	0.00
73	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
74	001328	登康口腔	120	3,058.80	0.00
75	603125	常青科技	109	2,673.77	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	002463	沪电股份	1,557,040.27	0.44
2	000066	中国长城	1,531,033.00	0.44
3	600372	中航电子	1,489,831.80	0.42
4	000423	东阿阿胶	1,353,810.00	0.38
5	000933	神火股份	1,273,443.00	0.36
6	002240	盛新锂能	1,263,675.00	0.36
7	002008	大族激光	1,163,370.00	0.33
8	603882	金域医学	1,160,456.00	0.33
9	688169	石头科技	1,055,556.30	0.30
10	300395	菲利华	1,044,662.52	0.30
11	002600	领益智造	1,018,352.00	0.29
12	688536	思瑞浦	982,336.12	0.28
13	688220	翱捷科技-U	963,518.52	0.27
14	601966	玲珑轮胎	921,594.00	0.26
15	300118	东方日升	919,970.00	0.26
16	300487	蓝晓科技	909,671.00	0.26
17	300595	欧普康视	896,281.00	0.25
18	002432	九安医疗	892,408.00	0.25
19	688072	拓荆科技	865,341.46	0.25
20	300438	鹏辉能源	855,051.00	0.24

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	603345	安井食品	1,860,965.00	0.53
2	603605	珀莱雅	1,690,173.00	0.48
3	601607	上海医药	1,626,754.00	0.46
4	688122	西部超导	1,619,283.53	0.46
5	000999	华润三九	1,511,512.00	0.43
6	603613	国联股份	1,400,128.45	0.40
7	002603	以岭药业	1,359,425.00	0.39
8	603606	东方电缆	1,335,277.54	0.38
9	601699	潞安环能	1,316,594.00	0.37
10	601872	招商轮船	1,254,761.00	0.36
11	300168	万达信息	1,164,360.00	0.33
12	600026	中远海能	1,064,641.00	0.30
13	688063	派能科技	1,063,921.75	0.30
14	601333	广深铁路	835,859.00	0.24
15	002212	天融信	728,552.00	0.21
16	600201	生物股份	720,690.90	0.20

17	600728	佳都科技	694,004.00	0.20
18	002396	星网锐捷	588,347.00	0.17
19	688088	虹软科技	580,551.96	0.17
20	600064	南京高科	530,197.20	0.15

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	100,714,519.73
卖出股票收入（成交）总额	73,158,848.47

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,033,426.32
2	应收清算款	248,267.41
3	应收股利	34,431.23
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	17,518.43
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,333,643.39

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	300308	中际旭创	1,253,325.00	0.30	转融通流通受限
2	002340	格林美	345,500.00	0.08	转融通流通受限
3	000988	华工科技	342,090.00	0.08	转融通流通受限
4	002384	东山精密	331,520.00	0.08	转融通流通受限
5	300418	昆仑万维	322,240.00	0.08	转融通流通受限
6	600157	永泰能源	309,134.00	0.07	转融通流通受限
7	688256	寒武纪-U	300,800.00	0.07	转融通流通受限
8	002422	科伦药业	296,800.00	0.07	转融通流通受限
9	600372	中航电子	294,492.00	0.07	转融通流通受限
10	300012	华测检测	273,000.00	0.07	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	118,203.00	0.03	新股未上市
1	301486	致尚科技	13,146.48	0.00	新股流通受限
2	301292	海科新源	102,668.64	0.02	新股未上市
2	301292	海科新源	11,414.29	0.00	新股流通受限
3	301488	豪恩汽电	80,315.82	0.02	新股未上市
3	301488	豪恩汽电	8,950.50	0.00	新股流通受限
4	688543	国科军工	12,148.45	0.00	新股流通受限
5	301315	威士顿	11,553.12	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

8.1.1 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 (%)
10,060	28,450.42	124,291,769.00	43.43	161,919,484.00	56.57

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国工商银行股份有限公司-鹏华中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	113,604,637.00	39.69

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	胡小彩	5,500,000.00	1.92
2	招商证券股份有限公司	3,775,560.00	1.32
3	方正证券股份有限公司	2,254,002.00	0.79
4	魏丽君	2,105,200.00	0.74
5	王雪有	2,000,000.00	0.70

6	于明中	1,986,700.00	0.69
7	长城基金—兴业银行—长城基金泓湖百世自动驾驶1号集合资产管理计划	1,867,900.00	0.65
8	金佳	1,826,400.00	0.64
9	秦珺	1,747,200.00	0.61
10	中信建投证券股份有限公司	1,619,599.00	0.57
-	中国工商银行股份有限公司—鹏华中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	113,604,637.00	39.69

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

注：截止本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

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

基金合同生效日（2019年11月21日） 基金份额总额	490,211,253.00
本报告期期初基金份额总额	252,211,253.00
本报告期基金总申购份额	56,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	22,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	286,211,253.00

§ 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 (%)	
中金公司	1	58,315,225.55	35.24	53,729.44	35.36	-
平安证券	1	55,353,757.91	33.45	50,998.24	33.56	-
国信证券	2	44,387,247.90	26.82	40,894.17	26.91	-
华西证券	1	2,669,136.00	1.61	2,192.08	1.44	-
国元证券	1	2,275,979.44	1.38	1,869.31	1.23	-
招商证券	1	1,912,211.22	1.16	1,761.76	1.16	-
国泰君安	1	290,019.76	0.18	267.17	0.18	-
国盛证券	1	285,690.10	0.17	234.61	0.15	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	本报告期新增
申万宏源	2	-	-	-	-	-

证券						
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	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 (%)
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国信证	-	-	-	-	-	-

券						
华西证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 04 日
2	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
3	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 10 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西南证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 20 日

5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国中金财富证券有限公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 03 日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东海证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 17 日
7	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 30 日
8	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 07 日
9	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日
10	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 17 日
11	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 03 日
12	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 05 日
13	鹏华基金管理有限公司关于鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金所持停牌股票估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 09 日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华福证券有限责任公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 12 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华福证券有限责任公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 12 日
16	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	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 28 日
17	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加德邦证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 29 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	62,577,637.00	59,727,000.00	8,700,000.00	113,604,637.00	39.69
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)《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 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