

# 鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF） 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 29 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 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	8
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>53</b>
7.1 期末基金资产组合情况	53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	69
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	69

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	69
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	69
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	69
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
7.12	投资组合报告附注	70
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>71</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
8.2	期末上市基金前十名持有人	71
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
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	72
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>72</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>73</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	73
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	73
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
10.4	基金投资策略的改变	73
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	73
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	74
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
10.8	其他重大事件	75
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>77</b>
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	77
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	77
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>77</b>
12.1	备查文件目录	77
12.2	存放地点	77
12.3	查阅方式	77

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)	
基金简称	鹏华中证 500 指数 (LOF)	
场内简称	鹏华 500LOF	
基金主代码	160616	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2010 年 2 月 5 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	322,588,664.11 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	2010 年 4 月 28 日	
下属分级基金的基金简称	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)
下属分级基金的场内简称	鹏华 500LOF	-
下属分级基金的交易代码	160616	006938
报告期末下属分级基金的份额总额	308,939,509.74 份	13,649,154.37 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资方式，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以实现中证 500 指数的有效跟踪。
投资策略	<p>本基金采用完全复制法，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。</p> <p>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。</p> <p>本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。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>当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制</p>

	<p>机构暂未作出调整的,基金管理人应当按照持有人利益优先的原则,履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p><b>1、股票投资策略</b></p> <p><b>(1) 股票投资组合的构建</b></p> <p>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><b>(2) 股票投资组合的调整</b></p> <p>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><b>1) 定期调整</b></p> <p>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。</p> <p><b>2) 不定期调整</b></p> <p>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;</p> <p>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。</p> <p><b>2、存托凭证投资策略</b></p> <p>本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上,根据审慎原则合理参与存托凭证的投资,以更好地跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p><b>3、债券投资策略</b></p> <p>本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略,自上而下地管理组合的久期,灵活地调整组合的券种搭配,同时精选个券,以增强组合的持有期收益。</p> <p><b>4、股指期货投资策略</b></p> <p>本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目标,选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,充分考虑股指期货的风险收益特征,通过多头或空头的套期保值策略,以改善投资组合的投资效果。</p>
--	---

	<p>5、资产支持证券的投资策略</p> <p>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。</p> <p>6、参与融资及转融通证券出借业务策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，在不改变投资目标的前提下，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。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数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
	联系电话	0755-81395402
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn
客户服务电话	4006788999	95588
传真	0755-82021126	(010) 66105798
注册地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	张纳沙	廖林

### 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)
本期已实现收益	-5,703,319.58	-252,397.04
本期利润	-35,369,773.00	-1,159,206.04
加权平均基金份 额本期利润	-0.1137	-0.0810
本期加权平均净 值利润率	-7.67%	-5.22%
本期基金份额净 值增长率	-7.47%	-7.57%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	128,261,755.74	6,564,403.75
期末可供分配基 金份额利润	0.4152	0.4809
期末基金资产净 值	437,201,265.48	20,213,558.12
期末基金份额净 值	1.4152	1.4809
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净 值增长率	41.52%	48.09%

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

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回



费、基金转换费等), 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.85%	0.90%	-6.55%	0.91%	0.70%	-0.01%
过去三个月	-5.00%	1.08%	-6.16%	1.09%	1.16%	-0.01%
过去六个月	-7.47%	1.50%	-8.46%	1.53%	0.99%	-0.03%
过去一年	-15.76%	1.19%	-16.71%	1.21%	0.95%	-0.02%
过去三年	-20.45%	1.12%	-25.98%	1.14%	5.53%	-0.02%
自基金合同生效起至今	41.52%	1.52%	14.40%	1.49%	27.12%	0.03%

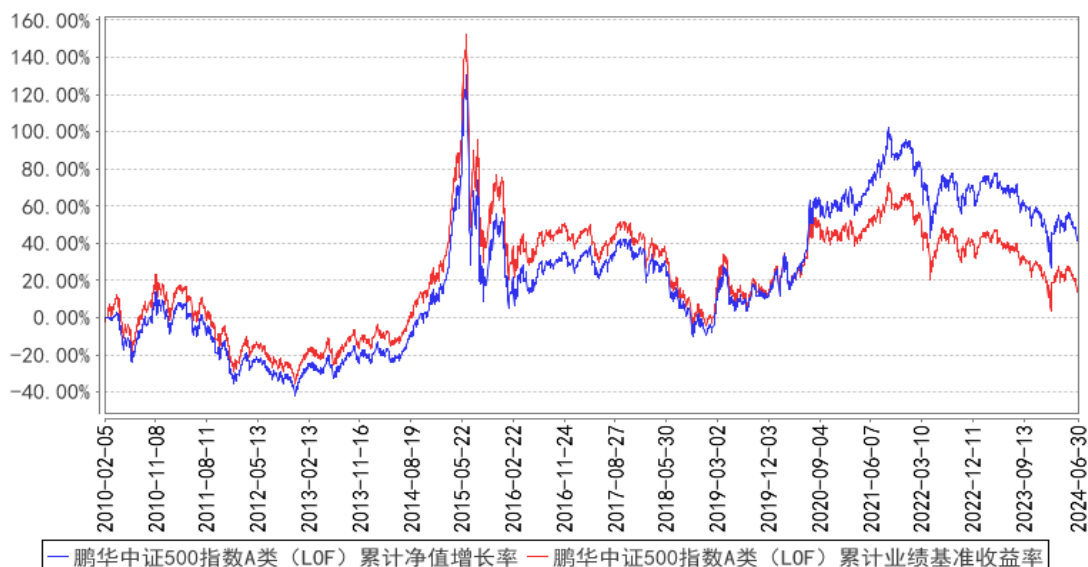
鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.87%	0.91%	-6.55%	0.91%	0.68%	0.00%
过去三个月	-5.05%	1.08%	-6.16%	1.09%	1.11%	-0.01%
过去六个月	-7.57%	1.50%	-8.46%	1.53%	0.89%	-0.03%
过去一年	-15.91%	1.19%	-16.71%	1.21%	0.80%	-0.02%
过去三年	-20.93%	1.12%	-25.98%	1.14%	5.05%	-0.02%
自基金合同生效起至今	48.09%	1.25%	13.15%	1.26%	34.94%	-0.01%

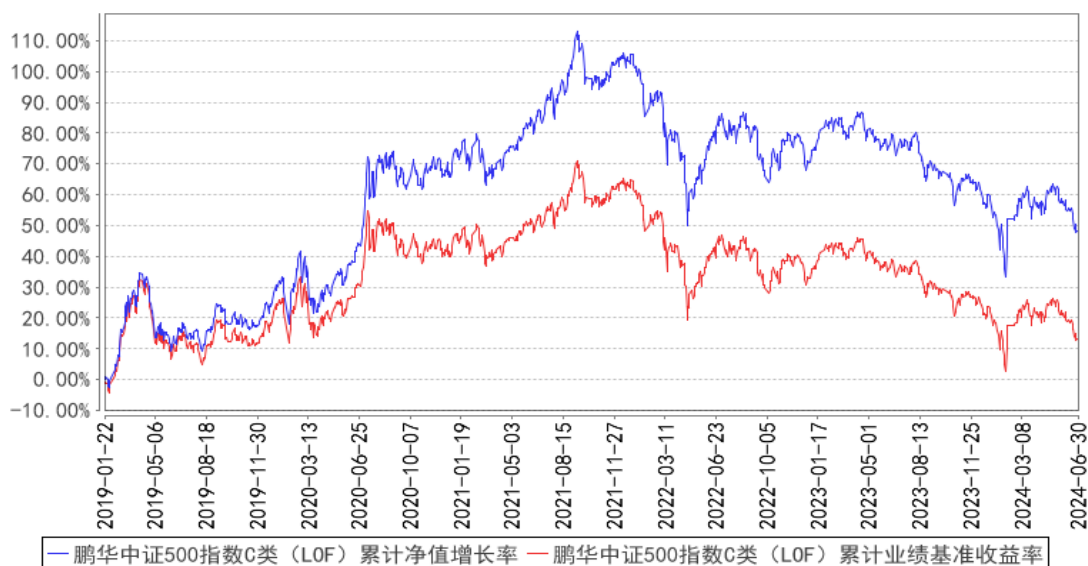
注: 业绩比较基准=中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%

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

鹏华中证500指数A类 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鹏华中证500指数C类 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2010 年 02 月 05 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日, 业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末, 公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.)、深圳市北融信投资发展有限公司组成, 公司性质为中外合资企业, 公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末, 公司资产管理总规模达到 12,020 亿元 (联接基金不折算, 不含投顾), 公司管理着 324 只公募基金、13 只全国社保投资组合、8 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		
余展昌	基金经理	2023-08-24	-	7 年	余展昌先生, 国籍中国, 金融硕士, 7 年证券从业经验。2017 年 7 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任量化及衍生品投资部量化研究员、高级量化研究员, 2020 年 8 月至 2022 年 10 月担任量化及衍生品投资部投资经理, 现担任量化及衍生品投资部基金经理。2022 年 10 月至今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, 2022 年 10 月至今担任鹏华中证 800 证券保险交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 10 月至今担任鹏华中证 800 证券保险指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 10 月至今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, 2022 年 10 月至今担任鹏华中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 10 月至今担任鹏华中证银行指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2023 年 08 月至今担任鹏华创业板指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2023 年 08 月至今担任鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2024 年 04 月至今担任鹏华恒生中国央企交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金经理, 余展昌

					先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
--	--	--	--	--	-------------------------------

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

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

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配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

作为宽基指数基金，本基金旨在为看好该宽基指数的投资者提供投资工具。本报告期内，本基金秉承指数基金的投资策略，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。跟踪误差的主要来源主要分为几个方面，包括成分股的调整、日常申赎的交易影响、指数本身的管理费用和交易费用、股票的分红、风险股票的处置、股票的打新等。为了进一步控制跟踪误差，鹏华基金建立了一套完备的指数跟踪机制，事前对成分股的异动进行密切跟踪，及时调整，在交易环节采用算法交易等方式进一步减少交易冲击成本和摩擦，在仓位控制上，基金经理在紧密跟踪指数的基础上，也会针对客户申赎的情况做优化调整。对于中证 500 指数，上半年可以明显观察到 ST 的公司数量在增加，对于该类风险股票，基金经理会及时进行研究跟进并处置，该处置会

领先于指数成分股的定期调整,也会一定程度上造成指数的跟踪误差。

板块方面,中证 500 指数上半年有一定的回调,一方面源于市场整体风险偏好的下行,另一方面,500 指数相对上证 50、沪深 300 等大盘指数,整体风格上偏成长,在年初以来大盘占优、红利占优的背景下,收益表现有所欠佳。展望后市,目前中证 500 指数的估值已经到了历史低点,性价比凸显,后续若随着政策的发力经济环境有所改善,叠加美联储降息的落地,成长板块会迎来一定的复苏。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本报告期 A 类份额净值增长率为-7.47%,同期业绩比较基准增长率为-8.46%;C 类份额净值增长率为-7.57%,同期业绩比较基准增长率为-8.46%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体而言,上半年的资本市场波动较大,但目前 A 股市场的估值已经达到了历史底部,投资性价比凸显。年初资本市场经历了较大的回调,主要源于对经济复苏的担忧以及对市场流动性风险的担忧。在监管的迅速响应下,资本市场得到了企稳与反弹。随着“新国九条”的发布,4 月政治局会议后存量地产优化政策的落地,以及海外降息预期升温等多重因素叠加下,资本市场迎来了一波反弹。但由于信贷数据未见明显回暖,内需仍然疲软,市场又有所下行。

目前看,国内外环境仍存一定的不确定性,但目前估值也到历史低点附近。后续市场的走势还是取决于国内经济复苏的情况,需要密切关注经济数据的变化,尤其是信贷数据的改善情况。若三季度财政支持力度进一步加大,地产存量优化的范围和力度也进一步扩大,对经济数据或能带来一定改善。但美国大选的结果,包括特朗普若成功当选后可能采取的系列举措可能成为扰动市场的因素,需要进行警惕。

年初以来,宽基指数的配置价值凸显,尤其是在整体市场风险偏好有所回落,行业轮动较大的情况下,资金会选择配置宽基指数跟踪大盘的整体表现。

#### 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、风控管理部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成,估值委员会成员具有多年的证券、基金从

业经验,熟悉相关法律法规,具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策,但不参与日常估值的执行。

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

本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末,鹏华中证 500 指数 A 类(LOF)期末可供分配利润为 128,261,755.74 元,期末基金份额净值 1.4152 元;鹏华中证 500 指数 C 类(LOF)期末可供分配利润为 6,564,403.75 元,期末基金份额净值 1.4809 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 2024 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 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2024 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
货币资金	6.4.7.1	27,912,266.23	29,569,108.94
结算备付金		3,328.99	37,784.39
存出保证金		13,960.65	221,606.45
交易性金融资产	6.4.7.2	428,795,573.40	470,159,610.50
其中: 股票投资		428,795,573.40	470,159,610.50
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中: 债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	92,817.10
应收股利		70,455.50	-
应收申购款		2,430,349.12	1,434,282.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	23,752.94	29,762.65
资产总计		459,249,686.83	501,544,972.07
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.67	-
应付赎回款		1,270,585.01	1,371,684.67

应付管理人报酬		291,392.95	318,004.95
应付托管费		58,278.58	63,600.99
应付销售服务费		3,251.36	3,672.91
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,127.85	4,633.94
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	207,226.81	329,821.88
负债合计		1,834,863.23	2,091,419.34
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	322,588,664.11	325,913,490.12
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	134,826,159.49	173,540,062.61
净资产合计		457,414,823.60	499,453,552.73
负债和净资产总计		459,249,686.83	501,544,972.07

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额为 322,588,664.11 份，其中鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF) 基金份额总额为 308,939,509.74 份，基金份额净值 1.4152 元；鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF) 基金份额总额为 13,649,154.37 份，基金份额净值 1.4809 元。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-34,239,689.07	22,699,868.90
1. 利息收入		686,162.27	73,574.17
其中：存款利息收入	6.4.7.13	51,739.12	73,574.17
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		-	-
其他利息收入		634,423.15	-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)		-4,365,689.83	894,971.51
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-10,340,499.37	-5,243,689.49
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	-	-



贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	5,974,809.54	6,138,661.00
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	-30,573,262.42	21,697,704.49
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	13,100.91	33,618.73
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2,289,289.97</b>	<b>2,847,715.73</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,803,956.12	2,169,187.21
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	360,791.23	433,837.47
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	22,332.28	45,021.40
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		2,284.77	-
8. 其他费用	6.4.7.23	99,925.57	199,669.65
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>-36,528,979.04</b>	<b>19,852,153.17</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		<b>-36,528,979.04</b>	<b>19,852,153.17</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-36,528,979.04</b>	<b>19,852,153.17</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	325,913,490.12	-	173,540,062.61	499,453,552.73

资产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	325,913,490.12	-	173,540,062.61	499,453,552.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,324,826.01	-	-38,713,903.12	-42,038,729.13
(一)、综合收益总额	-	-	-36,528,979.04	-36,528,979.04
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-3,324,826.01	-	-2,184,924.08	-5,509,750.09
其中：1. 基金申购款	33,154,432.37	-	16,678,437.58	49,832,869.95
2. 基金赎回款	-36,479,258.38	-	-18,863,361.66	-55,342,620.04
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	322,588,664.11	-	134,826,159.49	457,414,823.60
项目	上年度可比期间			
	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	346,013,663.39	-	218,635,435.56	564,649,098.95
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	346,013,663.39	-	218,635,435.56	564,649,098.95
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,775,616.16	-	13,795,631.80	7,020,015.64
(一)、综合收益总额	-	-	19,852,153.17	19,852,153.17
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-6,775,616.16	-	-6,056,521.37	-12,832,137.53
其中：1. 基金申购款	46,938,639.74	-	35,310,336.17	82,248,975.91
2. 基金赎回款	-53,714,255.90	-	-41,366,857.54	-95,081,113.44
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	339,238,047.23	-	232,431,067.36	571,669,114.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

聂连杰

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)(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[2009]第 1374 号《关于核准鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》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 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存

续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,629,831,732.31 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 021 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2010 年 2 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,630,723,634.12 份基金份额，其中认购资金利息折合 891,901.81 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 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年的经营成果和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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》, 自 2023 年 8 月 28 日起, 证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	27,912,266.23
等于：本金	27,909,807.73
加：应计利息	2,458.50
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	27,912,266.23

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	519,819,291.11	-	428,795,573.40	-91,023,717.71
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	519,819,291.11	-	428,795,573.40	-91,023,717.71

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

#### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	23,752.94
待摊费用	-
合计	23,752.94

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	254.68
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	107,518.23
其中：交易所市场	107,518.23
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,453.90
合计	207,226.81

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	312,393,218.17	312,393,218.17
本期申购	13,868,204.56	13,868,204.56
本期赎回 (以“-”号填列)	-17,321,912.99	-17,321,912.99
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	308,939,509.74	308,939,509.74

## 鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	13,520,271.95	13,520,271.95
本期申购	19,286,227.81	19,286,227.81
本期赎回 (以“-”号填列)	-19,157,345.39	-19,157,345.39
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	13,649,154.37	13,649,154.37

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	405,542,932.47	-240,144,207.23	165,398,725.24
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	405,542,932.47	-240,144,207.23	165,398,725.24
本期利润	-5,703,319.58	-29,666,453.42	-35,369,773.00
本期基金份额交易产生的变动数	-4,469,323.75	2,702,127.25	-1,767,196.50
其中：基金申购款	17,966,350.55	-11,509,350.78	6,456,999.77
基金赎回款	-22,435,674.30	14,211,478.03	-8,224,196.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	395,370,289.14	-267,108,533.40	128,261,755.74

##### 鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,211,204.16	-69,866.79	8,141,337.37
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	8,211,204.16	-69,866.79	8,141,337.37
本期利润	-252,397.04	-906,809.00	-1,159,206.04
本期基金份额交易产生的变动数	46,180.99	-463,908.57	-417,727.58
其中：基金申购款	11,629,680.42	-1,408,242.61	10,221,437.81
基金赎回款	-11,583,499.43	944,334.04	-10,639,165.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,004,988.11	-1,440,584.36	6,564,403.75

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	50,250.09
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	765.36
其他	723.67
合计	51,739.12

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-10,340,499.37
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-10,340,499.37

##### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	66,157,956.27
减：卖出股票成本总额	76,336,936.99
减：交易费用	161,518.65
买卖股票差价收入	-10,340,499.37

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,974,809.54
其中：证券出借权益补偿收入	981,345.45

基金投资产生的股利收益	-
合计	5,974,809.54

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-30,573,262.42
股票投资	-30,573,262.42
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-30,573,262.42

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	12,812.70
基金转换费收入	288.21
合计	13,100.91

#### 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	39,781.56
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	343.00
存托服务费	128.67
合计	99,925.57

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	11,557,558.31	8.88	-	-

###### 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 2024年1月1日至2024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	10,695.82	8.91	6,969.92	6.48
关联方名称	上年度可比期间 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	-	-	-	-

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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,803,956.12
其中：应支付销售机构的客户维护费	397,905.55	457,356.19
应支付基金管理人的净管理费	1,406,050.57	1,711,831.02

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.75%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.75%÷当年天数。

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

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	360,791.23	433,837.47

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

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)	合计
国信证券	-	154.23	154.23
鹏华基金公司	-	2,522.88	2,522.88
中国工商银行	-	552.09	552.09
合计	-	3,229.20	3,229.20
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)	合计
国信证券	-	83.04	83.04
鹏华基金公司	-	21,353.09	21,353.09
合计	-	21,436.13	21,436.13

注：鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF) 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF) 基金份额的销售服务费年费率为 0.2%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日分类基金资产净值×0.2%÷当年天数。

## 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	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	4,194,610.00	2.00~3.10	2.62	4,238.22	742,950.00	656.29
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	27,912,266.23	50,250.09	41,110,310.96	71,185.30

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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/)	总金额



				张 )	
国信证券	603325	博隆技术	网下申购	528	38,258.88
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位: 股/张)	总金额
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	2,618	104,144.04
国信证券	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40
国信证券	688562	航天软件	网下申购	7,254	91,980.72

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 (2024 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
001359	平安电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	雪祺电气于 2024 年 6 月 3 日每 10 股

										送 3 股
001389	广合科技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024 年 5 月 28 日	6 个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024 年 1 月 26 日	6 个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	骏鼎达于 2024 年 5 月 22 日每 10 股送 4 股
301539	宏鑫科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	11.88	18.98	590	7,009.20	11,198.20	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中	2024	6 个月	新股	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-

	瑞股份	年 3 月 27 日		流通受限						
301588	美新科技	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
601033	永兴股份	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股流通受限	16.20	15.96	569	9,217.80	9,081.24	-
603082	北自科技	2024 年 1 月 23 日	6 个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1 个月内 (含)	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股流通受限	72.46	68.06	53	3,840.38	3,607.18	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股流通受限	26.00	37.49	232	6,032.00	8,697.68	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安	2024	1 个月	新股	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-

	乃达	年 6 月 26 日	内 (含)	未上市						
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	23.35	25.13	167	3,899.45	4,196.71	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	22.66	15.89	520	11,783.20	8,262.80	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	143	12,435.28	25,014.99	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.69	18.79	568	8,911.92	10,672.72	-

注：1、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中需要限售的部分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。

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、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

#### 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
400174	中天 3	2023 年 08 月 30 日	重大事项	0.00	-	-	377,100	823,694.89	0.00	-

#### 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	000031	大悦城	2024 年 7 月 9 日	2.34	27,000	63,180.00
2	000155	川能动力	2024 年 7 月 3 日-2024 年 7 月 9 日	10.77	20,100	216,477.00
3	000401	冀东水泥	2024 年 7 月 3 日-2024 年 7 月 5 日	4.06	27,600	112,056.00
4	000559	万向钱潮	2024 年 7 月 5 日	4.46	7,000	31,220.00
5	000598	兴蓉环境	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 5 日	7.52	36,000	270,720.00
6	000629	钒钛股份	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 5 日	2.50	91,400	228,500.00
7	000739	普洛药业	2024 年 7 月 9 日	13.57	5,000	67,850.00
8	000831	中国稀	2024 年 7 月 3 日-2024	25.35	12,000	304,200.00

		土	年 7 月 9 日			0
9	000878	云南铜业	2024 年 7 月 1 日	12.46	3,500	43,610.00
10	000887	中鼎股份	2024 年 7 月 4 日	12.24	9,900	121,176.00
11	000937	冀中能源	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	6.70	25,900	173,530.00
12	000958	电投产融	2024 年 7 月 3 日	3.66	33,000	120,780.00
13	000967	盈峰环境	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 3 日	4.23	32,400	137,052.00
14	000988	华工科技	2024 年 7 月 1 日	29.93	27,100	811,103.00
15	000998	隆平高科	2024 年 7 月 3 日-2024 年 7 月 4 日	9.83	28,000	275,240.00
16	002044	美年健康	2024 年 7 月 3 日	3.78	11,400	43,092.00
17	002056	横店东磁	2024 年 7 月 1 日	12.47	22,000	274,340.00
18	002078	太阳纸业	2024 年 7 月 3 日	13.95	11,000	153,450.00
19	002080	中材科技	2024 年 7 月 1 日	12.90	18,000	232,200.00
20	002128	电投能源	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 4 日	21.10	17,500	369,250.00
21	002155	湖南黄金	2024 年 7 月 9 日	18.10	3,000	54,300.00
22	002240	盛新锂能	2024 年 7 月 4 日-2024 年 7 月 9 日	13.42	16,800	225,456.00
23	002368	太极股份	2024 年 7 月 1 日	22.55	12,000	270,600.00
24	002372	伟星新材	2024 年 7 月 9 日	15.42	15,000	231,300.00
25	002407	多氟多	2024 年 7 月 9 日	12.23	26,000	317,980.00
26	002408	齐翔腾达	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 2 日	5.60	38,000	212,800.00
27	002423	中粮资本	2024 年 7 月 3 日	7.49	23,000	172,270.00
28	002432	九安医疗	2024 年 7 月 1 日	40.54	7,000	283,780.00
29	002487	大金重工	2024 年 7 月 3 日-2024 年 7 月 9 日	22.88	9,900	226,512.00
30	002497	雅化集	2024 年 7 月 3 日	8.92	21,000	187,320.00

		团				0
31	002506	协鑫集成	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 2 日	1.94	60,000	116,400.00
32	002508	老板电器	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 4 日	22.10	12,000	265,200.00
33	002518	科士达	2024 年 7 月 1 日	17.70	6,400	113,280.00
34	002531	天顺风能	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 2 日	8.94	20,000	178,800.00
35	002557	洽洽食品	2024 年 7 月 5 日	28.19	7,000	197,330.00
36	002563	森马服饰	2024 年 7 月 3 日	5.81	21,000	122,010.00
37	002568	百润股份	2024 年 7 月 3 日	16.83	11,000	185,130.00
38	002572	索菲亚	2024 年 7 月 3 日	15.33	15,000	229,950.00
39	002595	豪迈科技	2024 年 7 月 1 日	38.17	1,800	68,706.00
40	002607	中公教育	2024 年 7 月 4 日	1.53	12,000	18,360.00
41	002624	完美世界	2024 年 7 月 3 日-2024 年 7 月 9 日	7.60	34,000	258,400.00
42	002653	海思科	2024 年 7 月 3 日	30.70	1,500	46,050.00
43	002739	万达电影	2024 年 7 月 9 日	12.09	23,600	285,324.00
44	002791	坚朗五金	2024 年 7 月 3 日	25.87	3,000	77,610.00
45	002831	裕同科技	2024 年 7 月 1 日	25.59	1,000	25,590.00
46	002867	周大生	2024 年 7 月 3 日-2024 年 7 月 9 日	13.06	11,500	150,190.00
47	002936	郑州银行	2024 年 7 月 9 日	1.73	40,000	69,200.00
48	003031	中瓷电子	2024 年 7 月 3 日	46.24	1,800	83,232.00
49	003035	南网能源	2024 年 7 月 5 日	4.40	7,000	30,800.00
50	300009	安科生物	2024 年 7 月 5 日	8.54	9,000	76,860.00
51	300017	网宿科技	2024 年 7 月 5 日	7.90	10,100	79,790.00
52	300024	机器人	2024 年 7 月 3 日-2024 年 7 月 4 日	9.74	21,000	204,540.00

53	300070	碧水源	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	4.19	58,200	243,858.00
54	300118	东方日升	2024 年 7 月 3 日-2024 年 7 月 10 日	12.10	12,000	145,200.00
55	300144	宋城演艺	2024 年 7 月 9 日	8.03	10,000	80,300.00
56	300212	易华录	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 3 日	16.83	11,700	196,911.00
57	300253	卫宁健康	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 3 日	5.90	10,000	59,000.00
58	300296	利亚德	2024 年 7 月 4 日	4.50	7,000	31,500.00
59	300373	扬杰科技	2024 年 7 月 4 日	38.90	8,000	311,200.00
60	300487	蓝晓科技	2024 年 7 月 9 日	41.76	6,000	250,560.00
61	300502	新易盛	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 10 日	105.55	9,500	1,002,725.00
62	300601	康泰生物	2024 年 7 月 3 日-2024 年 7 月 4 日	15.61	3,000	46,830.00
63	300604	长川科技	2024 年 7 月 3 日	27.17	9,000	244,530.00
64	300677	英科医疗	2024 年 7 月 3 日	26.81	400	10,724.00
65	300682	朗新集团	2024 年 7 月 9 日	8.51	17,000	144,670.00
66	300776	帝尔激光	2024 年 7 月 2 日-2024 年 7 月 9 日	45.96	3,100	142,476.00
67	300861	美畅股份	2024 年 7 月 3 日-2024 年 7 月 9 日	19.35	5,100	98,685.00
68	300866	安克创新	2024 年 7 月 4 日	71.21	3,500	249,235.00
69	301029	怡合达	2024 年 7 月 3 日	19.66	4,000	78,640.00
70	600021	上海电力	2024 年 7 月 9 日	9.89	38,000	375,820.00
71	600032	浙江新能	2024 年 7 月 3 日	7.28	2,000	14,560.00
72	600056	中国医药	2024 年 7 月 3 日	10.12	20,000	202,400.00
73	600060	海信视像	2024 年 7 月 4 日	24.74	8,000	197,920.00
74	600066	宇通客车	2024 年 7 月 1 日	25.80	6,000	154,800.00
75	600095	湘财股份	2024 年 7 月 5 日	5.96	20,000	119,200.00



76	600118	中国卫星	2024 年 7 月 9 日	22.23	14,000	311,220.00
77	600129	太极集团	2024 年 7 月 3 日	28.92	10,000	289,200.00
78	600131	国网信通	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 3 日	16.87	16,100	271,607.00
79	600153	建发股份	2024 年 7 月 3 日	8.93	40,500	361,665.00
80	600166	福田汽车	2024 年 7 月 4 日	2.25	78,700	177,075.00
81	600177	雅戈尔	2024 年 7 月 4 日	7.12	9,000	64,080.00
82	600258	首旅酒店	2024 年 7 月 9 日	12.35	18,000	222,300.00
83	600325	华发股份	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 4 日	6.50	39,900	259,350.00
84	600350	山东高速	2024 年 7 月 5 日	8.85	18,000	159,300.00
85	600373	中文传媒	2024 年 7 月 2 日	14.84	18,000	267,120.00
86	600377	宁沪高速	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 3 日	12.60	11,700	147,420.00
87	600378	昊华科技	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	28.90	7,100	205,190.00
88	600392	盛和资源	2024 年 7 月 5 日-2024 年 7 月 9 日	8.62	35,000	301,700.00
89	600418	江淮汽车	2024 年 7 月 3 日-2024 年 7 月 5 日	15.84	34,200	541,728.00
90	600481	双良节能	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 3 日	4.67	30,000	140,100.00
91	600483	福能股份	2024 年 7 月 2 日	11.66	22,000	256,520.00
92	600498	烽火通信	2024 年 7 月 9 日	15.90	19,000	302,100.00
93	600499	科达制造	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	8.43	21,400	180,402.00
94	600500	中化国际	2024 年 7 月 9 日	3.49	34,400	120,056.00
95	600516	方大炭素	2024 年 7 月 3 日-2024 年 7 月 4 日	4.31	74,900	322,819.00
96	600517	国网英大	2024 年 7 月 3 日	4.33	40,000	173,200.00
97	600536	中国软件	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 2 日	29.92	9,300	278,256.00
98	600546	山煤国	2024 年 7 月 1 日	14.62	26,000	380,120.00

		际				0
99	600582	天地科技	2024 年 7 月 1 日	6.89	44,600	307,294.00
100	600655	豫园股份	2024 年 7 月 3 日	5.15	10,600	54,590.00
101	600707	彩虹股份	2024 年 7 月 3 日	6.81	4,600	31,326.00
102	600739	辽宁成大	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 3 日	8.37	29,000	242,730.00
103	600755	厦门国贸	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 3 日	7.17	33,000	236,610.00
104	600764	中国海防	2024 年 7 月 10 日	19.63	5,000	98,150.00
105	600801	华新水泥	2024 年 7 月 3 日	13.75	18,000	247,500.00
106	600808	马钢股份	2024 年 7 月 3 日	2.02	26,300	53,126.00
107	600827	百联股份	2024 年 7 月 3 日	7.38	4,900	36,162.00
108	600859	王府井	2024 年 7 月 3 日	11.74	1,400	16,436.00
109	600871	石化油服	2024 年 7 月 4 日	1.74	100,000	174,000.00
110	600901	江苏金租	2024 年 7 月 3 日-2024 年 7 月 9 日	5.05	46,200	233,310.00
111	600956	新天绿能	2024 年 7 月 3 日	8.17	7,000	57,190.00
112	600968	海油发展	2024 年 7 月 1 日	4.12	15,000	61,800.00
113	600985	淮北矿业	2024 年 7 月 1 日	16.74	27,000	451,980.00
114	600988	赤峰黄金	2024 年 7 月 3 日	16.34	36,600	598,044.00
115	600995	南网储能	2024 年 7 月 1 日	9.66	10,000	96,600.00
116	601098	中南传媒	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 3 日	12.42	19,000	235,980.00
117	601106	中国一重	2024 年 7 月 3 日-2024 年 7 月 5 日	2.31	66,200	152,922.00
118	601118	海南橡胶	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 3 日	4.55	42,500	193,375.00
119	601128	常熟银行	2024 年 7 月 4 日	7.57	76,000	575,320.00
120	601158	重庆水务	2024 年 7 月 3 日	4.80	3,000	14,400.00

121	601179	中国西电	2024 年 7 月 9 日	8.04	5,000	40,200.00
122	601228	广州港	2024 年 7 月 9 日	3.05	40,000	122,000.00
123	601298	青岛港	2024 年 7 月 1 日	9.56	19,000	181,640.00
124	601456	国联证券	2024 年 7 月 1 日	9.64	22,000	212,080.00
125	601568	北元集团	2024 年 7 月 3 日	3.71	26,300	97,573.00
126	601666	平煤股份	2024 年 7 月 3 日-2024 年 7 月 4 日	11.20	28,800	322,560.00
127	601828	美凯龙	2024 年 7 月 3 日	2.55	9,000	22,950.00
128	601866	中远海发	2024 年 7 月 5 日	2.58	30,000	77,400.00
129	601928	凤凰传媒	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 3 日	10.96	11,400	124,944.00
130	601958	金钼股份	2024 年 7 月 9 日	10.41	23,000	239,430.00
131	601992	金隅集团	2024 年 7 月 9 日	1.37	56,600	77,542.00
132	603000	人民网	2024 年 7 月 1 日	19.99	7,000	139,930.00
133	603056	德邦股份	2024 年 7 月 9 日	13.10	1,300	17,030.00
134	603127	昭衍新药	2024 年 7 月 3 日	13.27	10,000	132,700.00
135	603185	弘元绿能	2024 年 7 月 3 日	17.09	2,800	47,852.00
136	603218	日月股份	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 9 日	10.27	12,000	123,240.00
137	603225	新凤鸣	2024 年 7 月 9 日	15.59	15,000	233,850.00
138	603228	景旺电子	2024 年 7 月 5 日	31.80	9,000	286,200.00
139	603233	大参林	2024 年 7 月 3 日	14.30	12,000	171,600.00
140	603305	旭升集团	2024 年 7 月 3 日	10.56	10,000	105,600.00
141	603444	吉比特	2024 年 7 月 1 日	178.01	1,200	213,612.00
142	603517	绝味食品	2024 年 7 月 1 日	15.40	5,000	77,000.00
143	603529	爱玛科	2024 年 7 月 2 日-2024	27.33	6,700	183,111.00

		技	年 7 月 9 日			0
144	603596	伯特利	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 3 日	38.90	2,700	105,030.00
145	603688	石英股份	2024 年 7 月 9 日	29.61	7,200	213,192.00
146	603707	健友股份	2024 年 7 月 3 日	11.88	12,000	142,560.00
147	603737	三棵树	2024 年 7 月 1 日	36.27	5,700	206,739.00
148	603816	顾家家居	2024 年 7 月 3 日-2024 年 7 月 5 日	32.29	5,300	171,137.00
149	603868	飞科电器	2024 年 7 月 1 日	38.40	1,300	49,920.00
150	603882	金域医学	2024 年 7 月 3 日	27.19	7,000	190,330.00
151	603927	中科软	2024 年 7 月 1 日	18.09	9,600	173,664.00
152	603939	益丰药房	2024 年 7 月 3 日	24.55	2,800	68,740.00
153	605358	立昂微	2024 年 7 月 4 日	23.14	11,000	254,540.00
154	688005	容百科技	2024 年 7 月 3 日-2024 年 7 月 9 日	23.28	7,800	181,584.00
155	688006	杭可科技	2024 年 7 月 9 日	17.45	6,000	104,700.00
156	688107	安路科技	2024 年 7 月 1 日	25.42	4,000	101,680.00
157	688114	华大智造	2024 年 7 月 5 日	47.41	5,000	237,050.00
158	688120	华海清科	2024 年 7 月 4 日	189.58	1,800	341,244.00
159	688153	唯捷创芯	2024 年 7 月 3 日	37.00	1,000	37,000.00
160	688169	石头科技	2024 年 7 月 9 日	392.60	1,000	392,600.00
161	688180	君实生物-U	2024 年 7 月 2 日	29.05	10,000	290,500.00
162	688200	华峰测控	2024 年 7 月 4 日	91.75	2,000	183,500.00
163	688220	翱捷科技-U	2024 年 7 月 1 日	37.46	3,400	127,364.00
164	688234	天岳先进	2024 年 7 月 9 日	46.92	2,000	93,840.00
165	688248	南网科	2024 年 7 月 1 日	29.63	2,300	68,149.00

		技				
166	688281	华秦科技	2024 年 7 月 9 日	83.32	1,000	83,320.00
167	688331	荣昌生物	2024 年 7 月 9 日	43.20	5,900	254,880.00
168	688348	昱能科技	2024 年 7 月 4 日	59.00	1,000	59,000.00
169	688385	复旦微电子	2024 年 7 月 3 日	31.38	5,500	172,590.00
170	688387	信科移动-U	2024 年 7 月 3 日	5.04	18,000	90,720.00
171	688390	固德威	2024 年 7 月 1 日	56.12	2,380	133,565.60
172	688425	铁建重工	2024 年 7 月 4 日	3.68	32,000	117,760.00
173	688525	佰维存储	2024 年 7 月 3 日	64.15	5,000	320,750.00
174	688536	思瑞浦	2024 年 7 月 9 日	97.81	1,000	97,810.00
175	688538	和辉光电-U	2024 年 7 月 1 日	1.98	110,000	217,800.00
176	688567	孚能科技	2024 年 7 月 1 日-2024 年 7 月 3 日	9.60	20,000	192,000.00
177	688772	珠海冠宇	2024 年 7 月 3 日	14.90	5,000	74,500.00
178	688778	厦钨新能	2024 年 7 月 1 日	31.24	4,600	143,704.00
179	688779	长远锂科	2024 年 7 月 3 日	4.63	3,000	13,890.00
180	688819	天能股份	2024 年 7 月 9 日	23.86	3,600	85,896.00
181	689009	九号公司-WD	2024 年 7 月 1 日	36.81	11,600	426,996.00
合计	-	-	-	-	3,195,380	32,887,501.60

#### 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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证），为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、债券回购、银行存款、货币市场工具、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 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2023 年 12 月 31 日：未持有）。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

的债券投资的公允价值。

于 2024 年 06 月 30 日, 本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值 (净资产) 无固定到期日且不计息, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注: 无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市, 其余亦可在银行间同业市场交易, 部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求, 其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算, 确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时, 本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度; 按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理, 以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外, 本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度: 根据质押品的资质确定质押率水平; 持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额; 并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时, 可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险, 包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率



敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金，其余大部分金融资产和金融负债不计息，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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	27,912,266.23	-	-	-	27,912,266.23
结算备付金	3,328.99	-	-	-	3,328.99
存出保证金	13,960.65	-	-	-	13,960.65
交易性金融资产	-	-	-	428,795,573.40	428,795,573.40
应收股利	-	-	-	70,455.50	70,455.50
应收申购款	-	-	-	2,430,349.12	2,430,349.12
其他资产	-	-	-	23,752.94	23,752.94
资产总计	27,929,555.87	-	-	431,320,130.96	459,249,686.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,270,585.01	1,270,585.01
应付管理人报酬	-	-	-	291,392.95	291,392.95
应付托管费	-	-	-	58,278.58	58,278.58
应付清算款	-	-	-	0.67	0.67
应付销售服务费	-	-	-	3,251.36	3,251.36
应交税费	-	-	-	4,127.85	4,127.85
其他负债	-	-	-	207,226.81	207,226.81
负债总计	-	-	-	1,834,863.23	1,834,863.23
利率敏感度缺口	27,929,555.87	-	-	-429,485,267.73	457,414,823.60
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	29,569,108.94	-	-	-	29,569,108.94
结算备付金	37,784.39	-	-	-	37,784.39
存出保证金	221,606.45	-	-	-	221,606.45
交易性金融资产	-	-	-	470,159,610.50	470,159,610.50
应收申购款	-	-	-	1,434,282.04	1,434,282.04
应收清算款	-	-	-	92,817.10	92,817.10
其他资产	-	-	-	29,762.65	29,762.65
资产总计	29,828,499.78	-	-	471,716,472.29	501,544,972.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,371,684.67	1,371,684.67

应付管理人报酬	-	-	-	318,004.95	318,004.95
应付托管费	-	-	-	63,600.99	63,600.99
应付销售服务费	-	-	-	3,672.91	3,672.91
应交税费	-	-	-	4,633.94	4,633.94
其他负债	-	-	-	329,821.88	329,821.88
负债总计	-	-	-	2,091,419.34	2,091,419.34
利率敏感度缺口	29,828,499.78	-	-	-469,625,052.95	499,453,552.73

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 2024 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券，所面临的其他价格风险来源于标的指数成份券和备选成份券证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）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%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到

期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，本基金在履行适当程序后以变更后的比例为准，本基金的投资比例可做相应调整。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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	428,795,573.40	93.74	470,159,610.50	94.13
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	428,795,573.40	93.74	470,159,610.50	94.13

注：债券投资为可转债、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。		
分析	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 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	21,402,439.60	23,274,535.56
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-21,402,439.60	-23,274,535.56

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 2024年6月30日
第一层次	428,521,885.76
第二层次	45,611.11
第三层次	228,076.53
合计	428,795,573.40

###### 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	428,795,573.40	93.37
	其中：股票	428,795,573.40	93.37
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	27,915,595.22	6.08
8	其他各项资产	2,538,518.21	0.55
9	合计	459,249,686.83	100.00

注：1、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

32,887,501.60 元，占基金资产净值比为 7.19%。

2、报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：1,328,877.81 元，占净值比 0.29%。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	2,686,870.32	0.59
B	采矿业	20,032,452.00	4.38
C	制造业	270,793,937.35	59.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供	17,259,683.40	3.77

	应业		
E	建筑业	4,361,758.00	0.95
F	批发和零售业	9,096,352.34	1.99
G	交通运输、仓储和邮政业	8,624,063.66	1.89
H	住宿和餐饮业	1,356,080.00	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,422,795.05	6.65
J	金融业	39,843,009.79	8.71
K	房地产业	4,846,348.64	1.06
L	租赁和商务服务业	3,272,497.21	0.72
M	科学研究和技术服务业	3,428,229.92	0.75
N	水利、环境和公共设施管理业	1,942,957.30	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	477,360.00	0.10
Q	卫生和社会工作	2,654,680.00	0.58
R	文化、体育和娱乐业	6,442,352.00	1.41
S	综合	766,296.96	0.17
	合计	428,307,723.94	93.64

### 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	434,965.84	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,383.26	0.01
J	金融业	-	-

K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	2,419.12	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,081.24	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	487,849.46	0.11

### 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	300502	新易盛	51,300	5,414,715.00	1.18
2	002028	思源电气	44,524	2,978,655.60	0.65
3	601058	赛轮轮胎	190,100	2,661,400.00	0.58
4	688169	石头科技	6,580	2,583,308.00	0.56
5	600066	宇通客车	96,000	2,476,800.00	0.54
6	002340	格林美	371,100	2,363,907.00	0.52
7	000933	神火股份	113,800	2,302,174.00	0.50
8	601077	渝农商行	447,400	2,245,948.00	0.49
9	000988	华工科技	72,650	2,174,414.50	0.48
10	601168	西部矿业	120,500	2,162,975.00	0.47
11	300394	天孚通信	23,980	2,120,311.60	0.46
12	002384	东山精密	98,800	2,045,160.00	0.45
13	000423	东阿阿胶	32,500	2,034,500.00	0.44
14	000630	铜陵有色	554,700	2,002,467.00	0.44
15	600418	江淮汽车	126,268	2,000,085.12	0.44
16	600988	赤峰黄金	120,200	1,964,068.00	0.43
17	601233	桐昆股份	121,900	1,945,524.00	0.43
18	600157	永泰能源	1,605,800	1,894,844.00	0.41
19	002625	光启技术	109,000	1,891,150.00	0.41

20	600096	云天化	92,800	1,802,176.00	0.39
21	601567	三星医疗	50,900	1,781,500.00	0.39
22	000400	许继电气	51,500	1,772,115.00	0.39
23	688777	中控技术	45,600	1,719,120.00	0.38
24	002156	通富微电	76,500	1,712,835.00	0.37
25	002128	电投能源	81,000	1,709,100.00	0.37
26	002273	水晶光电	100,484	1,706,218.32	0.37
27	601555	东吴证券	287,280	1,694,952.00	0.37
28	002078	太阳纸业	121,128	1,689,735.60	0.37
29	600885	宏发股份	60,212	1,666,668.16	0.36
30	601128	常熟银行	217,850	1,649,124.50	0.36
31	002532	天山铝业	201,700	1,635,787.00	0.36
32	300207	欣旺达	107,600	1,632,292.00	0.36
33	002223	鱼跃医疗	43,405	1,632,028.00	0.36
34	600352	浙江龙盛	188,100	1,615,779.00	0.35
35	600398	海澜之家	173,500	1,603,140.00	0.35
36	002138	顺络电子	58,200	1,598,172.00	0.35
37	002966	苏州银行	211,980	1,589,850.00	0.35
38	002353	杰瑞股份	44,400	1,557,552.00	0.34
39	601108	财通证券	234,900	1,552,689.00	0.34
40	688617	惠泰医疗	3,400	1,550,740.00	0.34
41	600765	中航重机	74,893	1,527,817.20	0.33
42	002185	华天科技	185,200	1,509,380.00	0.33
43	002517	恺英网络	155,500	1,485,025.00	0.32
44	600879	航天电子	190,700	1,481,739.00	0.32
45	603606	东方电缆	29,800	1,454,538.00	0.32
46	301236	软通动力	41,300	1,454,173.00	0.32
47	600873	梅花生物	144,300	1,445,886.00	0.32
48	600177	雅戈尔	200,700	1,428,984.00	0.31
49	601577	长沙银行	174,300	1,425,774.00	0.31
50	688099	晶晨股份	23,996	1,423,442.72	0.31
51	600109	国金证券	187,800	1,417,890.00	0.31
52	600079	人福医药	82,500	1,416,525.00	0.31
53	002738	中矿资源	52,720	1,412,896.00	0.31
54	300003	乐普医疗	95,100	1,411,284.00	0.31
55	600060	海信视像	56,600	1,400,284.00	0.31
56	300017	网宿科技	176,400	1,393,560.00	0.30
57	600497	驰宏锌锗	257,500	1,375,050.00	0.30
58	300136	信维通信	69,900	1,368,642.00	0.30
59	603160	汇顶科技	19,800	1,361,250.00	0.30
60	603979	金诚信	26,700	1,349,151.00	0.29
61	002202	金风科技	199,500	1,340,640.00	0.29
62	002739	万达电影	110,200	1,332,318.00	0.29



63	689009	九号公司-WD	36,101	1,328,877.81	0.29
64	000932	华菱钢铁	299,560	1,327,050.80	0.29
65	000683	远兴能源	188,700	1,303,917.00	0.29
66	600985	淮北矿业	77,800	1,302,372.00	0.28
67	002465	海格通信	125,500	1,300,180.00	0.28
68	600536	中国软件	43,435	1,299,575.20	0.28
69	600348	华阳股份	130,300	1,297,788.00	0.28
70	002409	雅克科技	20,600	1,295,946.00	0.28
71	688120	华海清科	6,800	1,289,144.00	0.28
72	002444	巨星科技	52,095	1,286,746.50	0.28
73	002281	光迅科技	34,360	1,284,033.20	0.28
74	000009	中国宝安	149,080	1,282,088.00	0.28
75	002008	大族激光	60,800	1,264,640.00	0.28
76	000878	云南铜业	101,300	1,262,198.00	0.28
77	002436	兴森科技	122,100	1,260,072.00	0.28
78	688122	西部超导	32,800	1,256,896.00	0.27
79	300474	景嘉微	19,800	1,251,954.00	0.27
80	600642	申能股份	141,400	1,248,562.00	0.27
81	601615	明阳智能	131,300	1,239,472.00	0.27
82	002797	第一创业	242,900	1,236,361.00	0.27
83	000039	中集集团	133,080	1,232,320.80	0.27
84	300054	鼎龙股份	54,200	1,229,256.00	0.27
85	601990	南京证券	159,800	1,227,264.00	0.27
86	600298	安琪酵母	43,900	1,226,127.00	0.27
87	300012	华测检测	121,600	1,223,296.00	0.27
88	000066	中国长城	139,800	1,223,250.00	0.27
89	600529	山东药玻	47,900	1,213,786.00	0.27
90	601666	平煤股份	107,300	1,201,760.00	0.26
91	002673	西部证券	193,800	1,199,622.00	0.26
92	600839	四川长虹	266,900	1,198,381.00	0.26
93	603596	伯特利	30,640	1,191,896.00	0.26
94	601179	中国西电	148,100	1,190,724.00	0.26
95	688525	佰维存储	18,500	1,186,775.00	0.26
96	000831	中国稀土	46,000	1,166,100.00	0.25
97	000783	长江证券	239,800	1,158,234.00	0.25
98	601717	郑煤机	78,005	1,154,474.00	0.25
99	300395	菲利华	37,500	1,153,125.00	0.25
100	300002	神州泰岳	141,700	1,150,604.00	0.25
101	603816	顾家家居	35,600	1,149,524.00	0.25
102	002432	九安医疗	28,300	1,147,282.00	0.25
103	000728	国元证券	189,200	1,146,552.00	0.25
104	000738	航发控制	57,000	1,143,990.00	0.25
105	600862	中航高科	60,400	1,134,312.00	0.25

106	000703	恒逸石化	158,900	1,126,601.00	0.25
107	688180	君实生物-U	38,700	1,124,235.00	0.25
108	601198	东兴证券	140,100	1,115,196.00	0.24
109	601997	贵阳银行	211,400	1,114,078.00	0.24
110	688188	柏楚电子	6,002	1,107,669.10	0.24
111	000960	锡业股份	71,300	1,104,437.00	0.24
112	002595	豪迈科技	28,900	1,103,113.00	0.24
113	002155	湖南黄金	60,800	1,100,480.00	0.24
114	603345	安井食品	14,800	1,099,788.00	0.24
115	603338	浙江鼎力	18,200	1,099,644.00	0.24
116	600863	内蒙华电	235,800	1,094,112.00	0.24
117	601696	中银证券	120,400	1,093,232.00	0.24
118	601162	天风证券	501,000	1,092,180.00	0.24
119	300037	新宙邦	38,120	1,088,707.20	0.24
120	300724	捷佳伟创	20,100	1,085,601.00	0.24
121	600038	中直股份	26,400	1,085,304.00	0.24
122	300866	安克创新	15,240	1,085,240.40	0.24
123	600521	华海药业	63,600	1,084,380.00	0.24
124	000921	海信家电	33,500	1,080,040.00	0.24
125	002472	双环传动	48,800	1,074,576.00	0.23
126	300001	特锐德	53,400	1,074,408.00	0.23
127	603939	益丰药房	43,728	1,073,522.40	0.23
128	002984	森麒麟	44,500	1,072,005.00	0.23
129	002294	信立泰	40,200	1,070,526.00	0.23
130	600141	兴发集团	55,718	1,063,099.44	0.23
131	600549	厦门钨业	61,500	1,060,875.00	0.23
132	600699	均胜电子	71,260	1,056,073.20	0.23
133	002407	多氟多	86,220	1,054,470.60	0.23
134	600546	山煤国际	71,600	1,046,792.00	0.23
135	300699	光威复材	41,980	1,042,363.40	0.23
136	002850	科达利	13,600	1,038,768.00	0.23
137	600820	隧道股份	159,000	1,038,270.00	0.23
138	002262	恩华药业	43,600	1,035,064.00	0.23
139	600895	张江高科	55,900	1,033,032.00	0.23
140	301358	湖南裕能	32,800	1,031,888.00	0.23
141	600369	西南证券	288,100	1,031,398.00	0.23
142	002195	岩山科技	410,621	1,030,658.71	0.23
143	600872	中炬高新	45,400	1,030,126.00	0.23
144	002064	华峰化学	143,400	1,028,178.00	0.22
145	300285	国瓷材料	57,600	1,028,160.00	0.22
146	000021	深科技	67,656	1,022,958.72	0.22
147	603589	口子窖	26,000	1,018,940.00	0.22
148	601000	唐山港	214,098	1,006,260.60	0.22

149	600021	上海电力	101,700	1,005,813.00	0.22
150	603087	甘李药业	21,700	1,005,144.00	0.22
151	300073	当升科技	29,200	1,001,852.00	0.22
152	300146	汤臣倍健	73,700	998,635.00	0.22
153	600486	扬农化工	17,600	993,520.00	0.22
154	000513	丽珠集团	26,620	990,530.20	0.22
155	300058	蓝色光标	179,700	977,568.00	0.21
156	600704	物产中大	225,200	977,368.00	0.21
157	601966	玲珑轮胎	53,200	977,284.00	0.21
158	002756	永兴材料	27,200	973,216.00	0.21
159	600153	建发股份	108,500	968,905.00	0.21
160	600155	华创云信	163,400	965,694.00	0.21
161	603179	新泉股份	24,600	965,304.00	0.21
162	300114	中航电测	21,300	963,825.00	0.21
163	000830	鲁西化工	83,027	962,282.93	0.21
164	300529	健帆生物	35,000	952,350.00	0.21
165	600118	中国卫星	42,700	949,221.00	0.21
166	688065	凯赛生物	20,900	948,651.00	0.21
167	600583	海油工程	159,700	943,827.00	0.21
168	002558	巨人网络	99,800	942,112.00	0.21
169	002152	广电运通	89,700	938,262.00	0.21
170	601156	东航物流	45,800	932,030.00	0.20
171	000591	太阳能	197,700	931,167.00	0.20
172	000623	吉林敖东	69,100	925,940.00	0.20
173	600970	中材国际	76,350	920,781.00	0.20
174	002025	航天电器	19,800	918,324.00	0.20
175	002385	大北农	237,700	915,145.00	0.20
176	300373	扬杰科技	23,500	914,150.00	0.20
177	300144	宋城演艺	113,600	912,208.00	0.20
178	002439	启明星辰	52,800	911,328.00	0.20
179	600380	健康元	80,848	903,072.16	0.20
180	601216	君正集团	243,900	899,991.00	0.20
181	000729	燕京啤酒	101,800	898,894.00	0.20
182	605358	立昂微	38,800	897,832.00	0.20
183	600143	金发科技	135,100	893,011.00	0.20
184	000723	美锦能源	187,600	892,976.00	0.20
185	300251	光线传媒	106,000	891,460.00	0.19
186	600998	九州通	182,218	889,223.84	0.19
187	600282	南钢股份	178,200	887,436.00	0.19
188	600637	东方明珠	145,700	885,856.00	0.19
189	000519	中兵红箭	60,308	884,718.36	0.19
190	300677	英科医疗	32,760	878,295.60	0.19
191	300383	光环新网	103,900	877,955.00	0.19

192	600516	方大炭素	203,600	877,516.00	0.19
193	600392	盛和资源	101,329	873,455.98	0.19
194	300024	机器人	89,600	872,704.00	0.19
195	000636	风华高科	66,800	872,408.00	0.19
196	600763	通策医疗	16,100	870,205.00	0.19
197	000818	航锦科技	39,200	865,536.00	0.19
198	002958	青农商行	321,200	860,816.00	0.19
199	601665	齐鲁银行	174,700	857,777.00	0.19
200	600909	华安证券	203,650	857,366.50	0.19
201	002044	美年健康	226,300	855,414.00	0.19
202	600008	首创环保	318,230	852,856.40	0.19
203	000883	湖北能源	141,300	849,213.00	0.19
204	600566	济川药业	26,600	843,486.00	0.18
205	000629	钒钛股份	335,900	839,750.00	0.18
206	601016	节能风电	280,700	839,293.00	0.18
207	600867	通化东宝	100,200	838,674.00	0.18
208	600511	国药股份	27,192	837,241.68	0.18
209	688213	思特威-W	17,200	834,200.00	0.18
210	300088	长信科技	177,400	833,780.00	0.18
211	601456	国联证券	86,300	831,932.00	0.18
212	000997	新大陆	59,586	828,841.26	0.18
213	600170	上海建工	385,300	828,395.00	0.18
214	600582	天地科技	119,645	824,354.05	0.18
215	600499	科达制造	97,000	817,710.00	0.18
216	600498	烽火通信	51,400	817,260.00	0.18
217	600535	天士力	64,700	813,926.00	0.18
218	601933	永辉超市	327,900	813,192.00	0.18
219	600129	太极集团	28,100	812,652.00	0.18
220	000598	兴蓉环境	107,800	810,656.00	0.18
221	600004	白云机场	85,500	810,540.00	0.18
222	002120	韵达股份	104,700	810,378.00	0.18
223	601991	大唐发电	268,700	808,787.00	0.18
224	000750	国海证券	276,880	805,720.80	0.18
225	600580	卧龙电驱	66,286	805,374.90	0.18
226	002261	拓维信息	72,400	801,468.00	0.18
227	000060	中金岭南	189,000	801,360.00	0.18
228	603000	人民网	39,900	797,601.00	0.17
229	300118	东方日升	65,900	797,390.00	0.17
230	300568	星源材质	97,200	797,040.00	0.17
231	300567	精测电子	14,000	791,140.00	0.17
232	002430	杭氧股份	35,500	789,875.00	0.17
233	002429	兆驰股份	163,500	786,435.00	0.17
234	603486	科沃斯	16,600	783,188.00	0.17

235	002939	长城证券	116,600	781,220.00	0.17
236	600166	福田汽车	347,000	780,750.00	0.17
237	603658	安图生物	16,918	779,412.26	0.17
238	603156	养元饮品	36,500	776,355.00	0.17
239	600325	华发股份	119,275	775,287.50	0.17
240	603228	景旺电子	24,288	772,358.40	0.17
241	600816	建元信托	284,600	771,266.00	0.17
242	601231	环旭电子	47,900	768,795.00	0.17
243	300765	新诺威	30,400	766,992.00	0.17
244	600673	东阳光	108,849	766,296.96	0.17
245	300487	蓝晓科技	18,250	762,120.00	0.17
246	603927	中科软	41,972	759,273.48	0.17
247	603568	伟明环保	36,865	758,681.70	0.17
248	600754	锦江酒店	33,000	758,340.00	0.17
249	000893	亚钾国际	46,900	757,904.00	0.17
250	002508	老板电器	34,200	755,820.00	0.17
251	300601	康泰生物	48,400	755,524.00	0.17
252	000027	深圳能源	103,100	752,630.00	0.16
253	601636	旗滨集团	116,300	750,135.00	0.16
254	002926	华西证券	113,800	749,942.00	0.16
255	000998	隆平高科	76,104	748,102.32	0.16
256	002624	完美世界	98,100	745,560.00	0.16
257	002497	雅化集团	83,300	743,036.00	0.16
258	603298	杭叉集团	37,800	742,392.00	0.16
259	600563	法拉电子	9,723	740,698.14	0.16
260	603290	斯达半导	8,600	740,546.00	0.16
261	600737	中粮糖业	77,200	740,348.00	0.16
262	002653	海思科	24,100	739,870.00	0.16
263	300604	长川科技	27,180	738,480.60	0.16
264	601866	中远海发	286,200	738,396.00	0.16
265	603077	和邦生物	446,780	737,187.00	0.16
266	300253	卫宁健康	124,800	736,320.00	0.16
267	002299	圣农发展	53,900	735,196.00	0.16
268	002065	东华软件	162,100	732,692.00	0.16
269	600131	国网信通	43,400	732,158.00	0.16
270	002056	横店东磁	58,708	732,088.76	0.16
271	002500	山西证券	155,670	731,649.00	0.16
272	688052	纳芯微	7,114	731,176.92	0.16
273	601958	金铂股份	69,900	727,659.00	0.16
274	002414	高德红外	123,400	726,826.00	0.16
275	300390	天华新能	42,280	726,370.40	0.16
276	688772	珠海冠宇	48,718	725,898.20	0.16
277	600373	中文传媒	48,900	725,676.00	0.16

278	688002	睿创微纳	25,916	724,870.52	0.16
279	600655	豫园股份	140,700	724,605.00	0.16
280	300009	安科生物	84,772	723,952.88	0.16
281	688385	复旦微电	23,000	721,740.00	0.16
282	300763	锦浪科技	17,300	720,372.00	0.16
283	002507	涪陵榨菜	58,365	714,971.25	0.16
284	002368	太极股份	31,497	710,257.35	0.16
285	603893	瑞芯微	12,000	710,040.00	0.16
286	002372	伟星新材	46,020	709,628.40	0.16
287	688114	华大智造	14,900	706,409.00	0.15
288	600707	彩虹股份	103,700	706,197.00	0.15
289	601611	中国核建	87,200	705,448.00	0.15
290	603885	吉祥航空	64,000	703,360.00	0.15
291	000887	中鼎股份	57,000	697,680.00	0.15
292	002203	海亮股份	86,600	691,068.00	0.15
293	603379	三美股份	17,600	688,864.00	0.15
294	002831	裕同科技	26,860	687,347.40	0.15
295	603225	新凤鸣	44,020	686,271.80	0.15
296	600755	厦门国贸	95,513	684,828.21	0.15
297	688390	固德威	12,166	682,755.92	0.15
298	600859	王府井	57,349	673,277.26	0.15
299	688521	芯原股份	25,100	671,425.00	0.15
300	601880	辽港股份	544,322	669,516.06	0.15
301	600995	南网储能	69,200	668,472.00	0.15
302	600801	华新水泥	48,530	667,287.50	0.15
303	600329	达仁堂	20,562	666,003.18	0.15
304	600416	湘电股份	67,000	665,980.00	0.15
305	600884	杉杉股份	81,600	662,592.00	0.14
306	002683	广东宏大	32,900	662,277.00	0.14
307	300070	碧水源	157,100	658,249.00	0.14
308	600390	五矿资本	162,500	658,125.00	0.14
309	300296	利亚德	146,200	657,900.00	0.14
310	002019	亿帆医药	53,100	656,316.00	0.14
311	002506	协鑫集成	338,200	656,108.00	0.14
312	600435	北方导航	75,872	654,016.64	0.14
313	002244	滨江集团	89,892	652,615.92	0.14
314	600483	福能股份	55,500	647,130.00	0.14
315	600739	辽宁成大	77,300	647,001.00	0.14
316	000050	深天马 A	88,800	646,464.00	0.14
317	601098	中南传媒	51,900	644,598.00	0.14
318	300803	指南针	17,700	644,457.00	0.14
319	300748	金力永磁	49,600	642,816.00	0.14
320	600399	抚顺特钢	114,000	641,820.00	0.14

321	601598	中国外运	113,900	641,257.00	0.14
322	600598	北大荒	51,300	640,737.00	0.14
323	002572	索菲亚	41,700	639,261.00	0.14
324	002568	百润股份	37,900	637,857.00	0.14
325	600901	江苏金租	126,260	637,613.00	0.14
326	000155	川能动力	58,800	633,276.00	0.14
327	002487	大金重工	27,600	631,488.00	0.14
328	600848	上海临港	69,200	630,412.00	0.14
329	300676	华大基因	18,000	630,180.00	0.14
330	002080	中材科技	48,500	625,650.00	0.14
331	002240	盛新锂能	46,600	625,372.00	0.14
332	001286	陕西能源	54,200	624,926.00	0.14
333	002373	千方科技	68,514	621,421.98	0.14
334	002936	郑州银行	357,723	618,860.79	0.14
335	002557	洽洽食品	21,900	617,361.00	0.13
336	300595	欧普康视	38,900	609,952.00	0.13
337	000563	陕国投 A	221,732	609,763.00	0.13
338	002268	电科网安	42,780	608,759.40	0.13
339	603712	七一二	33,400	607,546.00	0.13
340	600968	海油发展	146,900	605,228.00	0.13
341	603858	步长制药	39,900	604,485.00	0.13
342	688301	奕瑞科技	5,244	604,266.12	0.13
343	601928	凤凰传媒	55,100	603,896.00	0.13
344	603883	老百姓	32,882	603,713.52	0.13
345	000778	新兴铸管	173,000	602,040.00	0.13
346	688017	绿的谐波	7,300	599,330.00	0.13
347	600258	首旅酒店	48,400	597,740.00	0.13
348	601212	白银有色	214,000	594,920.00	0.13
349	688538	和辉光电-U	300,400	594,792.00	0.13
350	600271	航天信息	80,300	591,008.00	0.13
351	300558	贝达药业	18,100	589,155.00	0.13
352	600062	华润双鹤	30,012	587,634.96	0.13
353	600528	中铁工业	80,200	587,064.00	0.13
354	688234	天岳先进	12,370	580,400.40	0.13
355	002531	天顺风能	64,900	580,206.00	0.13
356	600977	中国电影	53,900	579,964.00	0.13
357	000709	河钢股份	298,800	579,672.00	0.13
358	601155	新城控股	65,300	579,211.00	0.13
359	603688	石英股份	19,500	577,395.00	0.13
360	002408	齐翔腾达	102,713	575,192.80	0.13
361	000739	普洛药业	42,200	572,654.00	0.13
362	600959	江苏有线	216,800	572,352.00	0.13
363	600378	昊华科技	19,700	569,330.00	0.12

364	688005	容百科技	24,300	565,704.00	0.12
365	688536	思瑞浦	5,767	564,070.27	0.12
366	601118	海南橡胶	123,700	562,835.00	0.12
367	688220	翱捷科技-U	15,000	561,900.00	0.12
368	000825	太钢不锈	165,300	558,714.00	0.12
369	603882	金域医学	20,300	551,957.00	0.12
370	603444	吉比特	3,100	551,831.00	0.12
371	603737	三棵树	15,200	551,304.00	0.12
372	688331	荣昌生物	12,700	548,640.00	0.12
373	600056	中国医药	54,012	546,601.44	0.12
374	000987	越秀资本	108,780	539,548.80	0.12
375	601399	国机重装	208,500	537,930.00	0.12
376	600906	财达证券	93,800	537,474.00	0.12
377	600517	国网英大	123,900	536,487.00	0.12
378	603456	九洲药业	39,000	535,080.00	0.12
379	601019	山东出版	45,200	534,264.00	0.12
380	688200	华峰测控	5,800	532,150.00	0.12
381	600612	老凤祥	9,100	529,529.00	0.12
382	300212	易华录	31,320	527,115.60	0.12
383	002266	浙富控股	188,540	526,026.60	0.11
384	600316	洪都航空	31,000	515,530.00	0.11
385	000937	冀中能源	76,600	513,220.00	0.11
386	600871	石化油服	294,200	511,908.00	0.11
387	603650	彤程新材	17,300	511,215.00	0.11
388	603529	爱玛科技	18,600	508,338.00	0.11
389	688567	孚能科技	52,800	506,880.00	0.11
390	600925	苏能股份	99,500	502,475.00	0.11
391	002423	中粮资本	66,600	498,834.00	0.11
392	000032	深桑达 A	32,800	491,344.00	0.11
393	601965	中国汽研	29,000	489,810.00	0.11
394	001227	兰州银行	205,800	489,804.00	0.11
395	688063	派能科技	12,320	489,227.20	0.11
396	603728	鸣志电器	12,100	486,783.00	0.11
397	600098	广州发展	76,000	486,400.00	0.11
398	600208	新湖中宝	307,400	485,692.00	0.11
399	601298	青岛港	50,600	483,736.00	0.11
400	688297	中无人机	14,500	478,935.00	0.10
401	601608	中信重工	125,400	477,774.00	0.10
402	002607	中公教育	312,000	477,360.00	0.10
403	002670	国盛金控	55,920	473,642.40	0.10
404	600663	陆家嘴	53,600	472,752.00	0.10
405	600022	山东钢铁	386,550	471,591.00	0.10
406	688516	奥特维	11,271	471,240.51	0.10



407	600578	京能电力	145,100	470,124.00	0.10
408	603233	大参林	32,864	469,955.20	0.10
409	300438	鹏辉能源	25,400	465,836.00	0.10
410	688561	奇安信-U	19,700	465,314.00	0.10
411	300357	我武生物	22,700	458,994.00	0.10
412	601106	中国一重	198,200	457,842.00	0.10
413	600500	中化国际	129,600	452,304.00	0.10
414	300776	帝尔激光	9,840	452,246.40	0.10
415	003031	中瓷电子	9,780	452,227.20	0.10
416	600377	宁沪高速	35,800	451,080.00	0.10
417	600967	内蒙一机	61,500	442,800.00	0.10
418	000785	居然之家	181,700	441,531.00	0.10
419	002865	钧达股份	11,500	441,370.00	0.10
420	600315	上海家化	24,413	434,063.14	0.09
421	600350	山东高速	48,900	432,765.00	0.09
422	688349	三一重能	17,300	429,732.00	0.09
423	300888	稳健医疗	16,940	428,582.00	0.09
424	600827	百联股份	57,900	427,302.00	0.09
425	000958	电投产融	116,700	427,122.00	0.09
426	000537	中绿电	44,800	426,944.00	0.09
427	000559	万向钱潮	95,500	425,930.00	0.09
428	601568	北元集团	114,800	425,908.00	0.09
429	688425	铁建重工	115,600	425,408.00	0.09
430	002608	江苏国信	54,600	423,150.00	0.09
431	002690	美亚光电	25,490	420,585.00	0.09
432	000156	华数传媒	66,900	420,132.00	0.09
433	603707	健友股份	34,989	415,669.32	0.09
434	002867	周大生	31,650	413,349.00	0.09
435	601992	金隅集团	301,300	412,781.00	0.09
436	603517	绝味食品	26,800	412,720.00	0.09
437	688029	南微医学	6,700	412,452.00	0.09
438	688032	禾迈股份	3,576	410,453.28	0.09
439	603826	坤彩科技	14,140	409,635.80	0.09
440	600126	杭钢股份	97,600	401,136.00	0.09
441	300682	朗新集团	47,000	399,970.00	0.09
442	003022	联泓新科	28,900	396,219.00	0.09
443	000967	盈峰环境	91,900	388,737.00	0.08
444	688475	萤石网络	11,300	385,443.00	0.08
445	603218	日月股份	37,200	382,044.00	0.08
446	600032	浙江新能	52,100	379,288.00	0.08
447	600361	创新新材	94,000	378,820.00	0.08
448	600481	双良节能	81,100	378,737.00	0.08
449	688778	厦钨新能	12,100	378,004.00	0.08

450	688520	神州细胞-U	9,600	377,760.00	0.08
451	600339	中油工程	121,000	377,520.00	0.08
452	301267	华夏眼科	18,200	377,104.00	0.08
453	603786	科博达	5,800	372,070.00	0.08
454	600095	湘财股份	61,900	368,924.00	0.08
455	000898	鞍钢股份	172,800	366,336.00	0.08
456	603127	昭衍新药	27,296	362,217.92	0.08
457	688248	南网科技	12,200	361,486.00	0.08
458	003035	南网能源	82,100	361,240.00	0.08
459	600808	马钢股份	173,800	351,076.00	0.08
460	688281	华秦科技	4,172	347,611.04	0.08
461	002563	森马服饰	58,400	339,304.00	0.07
462	002153	石基信息	59,122	338,769.06	0.07
463	603185	弘元绿能	19,600	334,964.00	0.07
464	601228	广州港	109,000	332,450.00	0.07
465	000539	粤电力 A	64,300	326,644.00	0.07
466	688779	长远锂科	69,700	322,711.00	0.07
467	001872	招商港口	16,700	321,475.00	0.07
468	600928	西安银行	96,300	314,901.00	0.07
469	001203	大中矿业	32,600	313,286.00	0.07
470	000401	冀东水泥	76,800	311,808.00	0.07
471	000959	首钢股份	112,600	306,272.00	0.07
472	600764	中国海防	15,400	302,302.00	0.07
473	688006	杭可科技	17,296	301,815.20	0.07
474	002518	科士达	16,900	299,130.00	0.07
475	603056	德邦股份	22,200	290,820.00	0.06
476	603305	旭升集团	26,900	284,064.00	0.06
477	600299	安迪苏	29,000	281,300.00	0.06
478	688172	燕东微	17,200	278,296.00	0.06
479	601139	深圳燃气	41,500	277,220.00	0.06
480	300861	美畅股份	13,800	267,030.00	0.06
481	603317	天味食品	23,012	262,566.92	0.06
482	688276	百克生物	8,900	252,493.00	0.06
483	688387	信科移动-U	49,400	248,976.00	0.05
484	301029	怡合达	12,480	245,356.80	0.05
485	688375	国博电子	3,400	240,176.00	0.05
486	002791	坚朗五金	9,200	238,004.00	0.05
487	600927	永安期货	21,000	234,150.00	0.05
488	688819	天能股份	9,726	232,062.36	0.05
489	688153	唯捷创芯	6,000	222,000.00	0.05
490	688107	安路科技	8,665	220,264.30	0.05
491	601858	中国科传	11,400	217,968.00	0.05
492	000031	大悦城	92,883	217,346.22	0.05

493	601158	重庆水务	41,600	199,680.00	0.04
494	601828	美凯龙	78,300	199,665.00	0.04
495	688348	昱能科技	3,300	194,700.00	0.04
496	002945	华林证券	19,500	194,610.00	0.04
497	600956	新天绿能	22,200	181,374.00	0.04
498	301165	锐捷网络	4,900	146,216.00	0.03
499	688295	中复神鹰	7,100	144,130.00	0.03
500	603868	飞科电器	3,400	130,560.00	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	301580	爱迪特	2,018	153,513.06	0.03
2	603381	永臻股份	1,666	46,168.71	0.01
3	688692	达梦数据	143	25,014.99	0.01
4	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
5	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
6	301526	国际复材	6,059	20,176.47	0.00
7	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
8	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
9	301565	中仑新材	590	11,198.20	0.00
10	688709	成都华微	568	10,672.72	0.00
11	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
12	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
13	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
14	601033	永兴股份	569	9,081.24	0.00
15	603341	龙旗科技	232	8,697.68	0.00
16	688584	上海合晶	520	8,262.80	0.00
17	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
18	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
19	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
20	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
21	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
22	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
23	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
24	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
25	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
26	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
27	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
28	603325	博隆技术	53	3,607.18	0.00
29	603004	鼎龙科技	195	3,305.25	0.00
30	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
31	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00

32	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
33	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
34	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
35	603373	安邦护卫	88	2,419.12	0.00
36	400174	中天 3	377,100	0.00	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	688777	中控技术	1,945,719.45	0.39
2	601567	三星医疗	1,722,230.00	0.34
3	688617	惠泰医疗	1,508,096.70	0.30
4	002202	金风科技	1,487,499.00	0.30
5	601615	明阳智能	1,404,844.00	0.28
6	002436	兴森科技	1,391,613.00	0.28
7	603979	金诚信	1,364,405.00	0.27
8	301358	湖南裕能	1,354,166.00	0.27
9	300002	神州泰岳	1,308,731.00	0.26
10	000921	海信家电	1,285,972.00	0.26
11	300054	鼎龙股份	1,254,362.00	0.25
12	600872	中炬高新	1,190,519.00	0.24
13	603345	安井食品	1,181,730.00	0.24
14	002984	森麒麟	1,114,455.00	0.22
15	688525	佰维存储	1,061,990.57	0.21
16	603179	新泉股份	1,040,898.00	0.21
17	603087	甘李药业	1,017,338.00	0.20
18	000818	航锦科技	978,507.00	0.20
19	688065	凯赛生物	960,071.71	0.19
20	600763	通策医疗	931,722.00	0.19

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002463	沪电股份	3,505,054.60	0.70
2	002422	科伦药业	3,065,866.00	0.61
3	000975	银泰黄金	2,471,739.20	0.49
4	600160	巨化股份	2,272,207.60	0.45
5	300418	昆仑万维	2,212,698.00	0.44
6	600161	天坛生物	1,963,096.40	0.39
7	600415	小商品城	1,726,408.00	0.35

8	600482	中国动力	1,528,469.00	0.31
9	688072	拓荆科技	1,445,508.75	0.29
10	002600	领益智造	1,076,834.00	0.22
11	688728	格科微	789,876.11	0.16
12	002131	利欧股份	714,462.20	0.14
13	000581	威孚高科	650,232.00	0.13
14	002032	苏泊尔	634,433.00	0.13
15	000547	航天发展	614,867.00	0.12
16	002092	ST 中泰	596,876.76	0.12
17	300026	红日药业	588,759.00	0.12
18	000970	中科三环	567,143.20	0.11
19	601778	晶科科技	565,014.00	0.11
20	688082	盛美上海	546,777.68	0.11

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	65,546,162.31
卖出股票收入（成交）总额	66,157,956.27

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

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

思源电气股份有限公司在报告编制日前一年内受到中华人民共和国洋山港海事局的处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	13,960.65
2	应收清算款	-
3	应收股利	70,455.50
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,430,349.12
6	其他应收款	23,752.94
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,538,518.21

### 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	300502	新易盛	1,002,725.00	0.22	转融通流通受限
2	000988	华工科技	811,103.00	0.18	转融通流通受限

3	688169	石头科技	392,600.00	0.09	转融通流通受限
4	600066	宇通客车	154,800.00	0.03	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	688692	达梦数据	25,014.99	0.01	新股流通受限
2	603285	键邦股份	21,596.70	0.00	新股未上市
2	603285	键邦股份	2,405.85	0.00	新股流通受限
3	603350	安乃达	19,429.20	0.00	新股未上市
3	603350	安乃达	2,179.36	0.00	新股流通受限
4	301580	爱迪特	13,317.86	0.00	新股流通受限
5	603381	永臻股份	4,196.71	0.00	新股流通受限

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	30,084	10,269.23	107,421,552.96	34.77	201,517,956.78	65.23
鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)	1,073	12,720.55	166,176.96	1.22	13,482,977.41	98.78
合计	31,157	10,353.65	107,587,729.92	33.35	215,000,934.19	66.65

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	赵建伟	448,372.00	8.92

2	施红梅	196,914.00	3.92
3	陈吉荃	150,042.00	2.99
4	鹿敏理	119,003.00	2.37
5	俞富良	117,026.00	2.33
6	于兆瑞	106,303.00	2.12
7	赵丽丽	100,017.00	1.99
8	张碧云	100,003.00	1.99
9	汪心红	90,005.00	1.79
10	王曦	90,000.00	1.79

注：持有人为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	56,860.34	0.0184
	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)	73,676.77	0.5398
	合计	130,537.11	0.0405

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

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)
基金合同生效日 (2010 年 2 月 5 日) 基金份额总额	2,630,723,634.12	-
本报告期期初基金份额总额	312,393,218.17	13,520,271.95
本报告期基金总申购份额	13,868,204.56	19,286,227.81
减：本报告期基金总赎回份额	17,321,912.99	19,157,345.39
本报告期基金拆分	-	-



变动份额		
本报告期期末基金份额总额	308,939,509.74	13,649,154.37

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

本报告期内，公司原副总经理王宗合先生辞去本公司副总经理职务，经公司第六届董事会第二百零四次会议审议通过，董事会同意王宗合先生不再担任公司副总经理，离任日期为 2024 年 2 月 6 日。

本报告期内，公司原副总经理邢彪先生辞去本公司副总经理职务，经公司第六届董事会第二百一十七次会议审议通过，董事会同意邢彪先生不再担任公司副总经理，离任日期为 2024 年 4 月 11 日。

本报告期内，公司原董事长何如先生不再担任公司董事长。经公司 2024 年第三次临时股东大会和第六届董事会第二百一十八次会议审议通过，股东会同意聘任张纳沙女士担任公司董事，董事会选举张纳沙女士担任公司董事长，任职日期自 2024 年 4 月 12 日起。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

无。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及相关责任人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 4 月 19 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	责令改正及警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定未严格执行, 个别业务内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见)	管理人高度重视, 按照法律法规及相关要求积极落实整改工作。截至报告日, 上述事项已整改完毕
其他	-

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 (%)	
银河证券	1	62,684,356.09	48.15	57,863.94	48.18	-
广发证券	1	47,855,310.85	36.76	44,088.67	36.71	-
国信证券	2	11,557,558.31	8.88	10,695.82	8.91	-
长江证券	1	8,080,062.69	6.21	7,443.76	6.20	-
海通证券	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;
- (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;
- (4) 合规风控能力较强, 内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度;

(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) 交易、研究服务能力较强。

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。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、合规风控能力和交易、研究水平等后，向券商租用交易单元作为基金交易单元。

### 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 (%)
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

### 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	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购博隆技术首次公开发行股票的公告	《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	2024 年 01 月 04 日
2	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	2024 年 01 月 18 日
3	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2023 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	2024 年 01 月 19 日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 23 日

5	鹏华基金管理有限公司关于暂停北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 02 月 02 日
6	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《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	2024 年 02 月 08 日
7	鹏华基金管理有限公司关于终止与北京中期时代基金销售有限公司销售合作关系的公告	《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	2024 年 03 月 04 日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华福证券有限责任公司申购 (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	2024 年 03 月 16 日
9	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2023 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	2024 年 03 月 28 日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金持有的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	2024 年 03 月 30 日
11	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《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	2024 年 04 月 13 日
12	鹏华基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《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	2024 年 04 月 13 日
13	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2024 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	2024 年 04 月 19 日
14	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	2024 年 05 月 10 日
15	鹏华基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户证件类型类型的公告	《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	2024 年 05 月 16 日
16	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低赎回份额和账户最低份额余额限制的公告	《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	2024 年 06 月 12 日
17	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (C 类基金份额) (LOF) 基金产品资料概要 (更新)	《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	2024 年 06 月 28 日
18	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (A 类基金份额) (LOF) 基金产品资料概要 (更新)	《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	2024 年 06 月 28 日

注：无。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240101~20240630	107,272,958.74	0.00	0.00	107,272,958.74	33.25
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 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》;
- (二)《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》;
- (三)《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2024 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

2024 年 8 月 29 日