

鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 31 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 2020 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 2020 年 01 月 01 日起至 2020 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	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	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的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60

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	60
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	60
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	60
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	60
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息.....	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末上市基金前十名持有人	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
§ 9 开放式基金份额变动.....	63
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§ 12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 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 500
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	160,211,253.00 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</p>

	<p>成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。 1) 定期调整 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。 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 姓名	张戈	郭明

负责人	联系电话	0755-82825720	010-66105799
	电子邮箱	zhangge@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(2020年1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	32,595,638.06
本期利润	39,571,859.70
加权平均基金份额本期利润	0.1178
本期加权平均净值利润率	11.42%
本期基金份额净值增长率	13.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	16,476,599.12
期末可供分配基金份额利润	0.1028
期末基金资产净值	182,586,649.38
期末基金份额净值	1.1397
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	13.97%

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。

(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

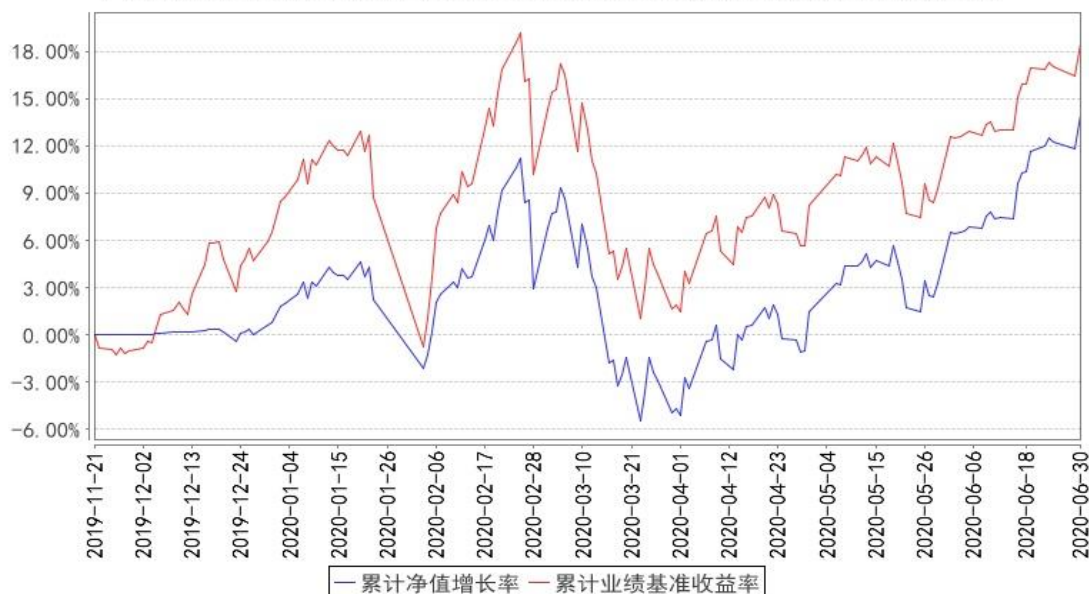
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	10.31%	0.90%	8.47%	0.88%	1.84%	0.02%
过去三个月	19.59%	1.13%	16.32%	1.13%	3.27%	0.00%
过去六个月	13.03%	1.52%	11.33%	1.79%	1.70%	-0.27%
自基金合同生效起至今	13.97%	1.36%	18.56%	1.64%	-4.59%	-0.28%

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，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。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。截止本报告期末，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，注册资本 15,000 万元人民币。截至 2020 年 6 月，公司管理资产总规模达到 7,014.31 亿元，管理 196 只公募基金、12 只全国社保投资组合、4 只基本养老保险投资组合。经过 22 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	本基金基金经理	2019-11-21	-	11 年	陈龙先生，国籍中国，经济学硕士，11 年证券基金从业经验。曾任杭州衡泰软件公

				<p>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副总经理、基金经理。2015 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华钢铁分级基金基金经理，2016 年 07 月至 2018 年 04 月担任鹏华创业板分级基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 04 月担任鹏华地产分级基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华香港中小企业指数（LOF）基金基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 04 月担任鹏华互联网分级基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华国防分级基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华证券分级基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华空天一体军工指数（LOF）基金基金经理，2019 年 03 月担任鹏华证券保险分级基金基金经理，2019 年 11 月担任中证 500 基金基金经理，2019 年 12 月担任龙头券商基金基金经理，2020 年 01 月担任鹏华中证 500ETF 联接基金基金经理。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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

报告期内，上证指数下跌 2.15%，深证成指上涨 14.97%，本基金跟踪的中证 500 指数上涨 11.33%。

报告期末，本基金份额净值为 1.1397 元，累计净值 1.1397 元。本报告期基金份额净值增长率为 13.03%，同期业绩比较基准收益率为 11.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年上半年，A 股呈现极端分化的行情。沪深 300 指数上涨 1.64%，中证 500 指数上涨 11.33%，创业板指上涨 35.60%。分行业来看，医药、科技和消费板块表现强势，金融、周期表现羸弱。

突发的疫情对上半年经济运行以及资本市场都带来的显著影响。总量上，央行为对冲疫情造成的经济冲击，总体上维持较为宽松的流动性，虽然 2 季度开始，边际上有所收紧；结构上，将行业分为疫情受益行业和受损行业，医药、科技等疫情受益行业获得资金的追捧，估值不断抬升，而金融、周期行情则受疫情拖累较为严重，估值处于历史地位。此外，2019 年以来，主动偏股型基金整体业绩表现良好，形成较好的赚钱效应，吸引居民资金借道公募基金间接参与资本市场，也为市场带来的可观的增量资金，进一步强化了市场风格。

展望 2020 年下半年，国内疫情基本得到控制，经济有望步入弱复苏的通道。国家统计局公布的二季度经济数据显示，二季度单季度 GDP 同比增长 3.2%，较一季度的-6.8%已有显著改善，下半年大概率仍会延续复苏的态势。同时，我们也看到，目前海外的疫情仍未得到较好的控制，发达经济体的经济下行压力较大，势必也会给我们出口带来较大的影响，影响国内经济的持续复苏。政策方面，未来仍需要保持相对宽松的流动性环境，货币政策的目标将从宽货币转向宽信用，同时积极的财政政策将发挥更为重要的作用。

同时，我们也关注到近期海外局势持续紧张，在美国大选的背景下，中美对抗持续升级，给

资本市场带来巨大的扰动，这种状态可能会贯穿整个下半年，甚至是更长的时间。但我们相信，出现极端冲突仍属于小概率事件，市场最终会逐步消化中美对抗带来的不确定性。而且目前国内的货币政策和财政政策仍留有较大的余地，能够较好的对冲海外事件的影响。中长期来看，国内大循环会持续受到重视，利用国内不同地区经济发展水平的差异，构建国内大循环，从而保证国内生产链和供应链的稳定性。

具体到下半年的投资机会，我们认为在目前宽信用、低增长、低通胀和强改革的背景，对股票市场是相对有利的。而且考虑到后续以注册制为代表的资本市场改革将持续推进，监管需要营造一个相对稳定、良好的市场环境。

结构上，我们认为可以关注以下几个方面：1) 消费、医药和科技仍然是中长期的主线，但考虑这些板块的整体估值处于历史高位，未来个股之间会形成分化，优质的公司可以通过业绩的增长来消化估值；2) 在经济弱复苏的趋势下，可选消费板块值得特别关注，包括保险、旅游酒店等；3) 科技方向，5G 的换机需求也是下半年相对确定的机会，可以积极关注消费电子行业的机会；4) 国防军工行业可能迎来拐点线的机会，一方面是行业自身周期性的变化，另一方面是“十四五”的储备需求带来行业至少两年左右的景气周期。

本基金将积极应对各种因素指数跟踪效果带来的冲击，本基金将积极应对各种因素指数跟踪效果带来的冲击，努力使得跟踪误差控制在基金合同规定的范围内，力争为投资者带来超越指数收益回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1) 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

(2) 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

3、本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4. 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

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 16,476,599.12 元，期末基金份额净值 1.1397 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、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，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各

重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

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鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金本中期报告中财务指标、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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,004,491.08	67,972,890.52
结算备付金		9,074,860.14	200,000,000.00
存出保证金		1,616,074.50	-
交易性金融资产	6.4.7.2	168,438,826.03	250,195,482.03
其中：股票投资		168,438,826.03	250,195,482.03
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		388,192.73	-
应收利息	6.4.7.5	1,536.84	67,784.34
应收股利		500.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		183,524,481.32	518,236,156.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		-	-
应付证券清算款		5,230.64	23,615,164.60
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		25,338.76	62,553.94
应付托管费		8,446.25	20,851.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	178,560.67	213,623.75
应交税费		37,552.47	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	682,703.15	22,282.61
负债合计		937,831.94	23,934,476.21
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	160,211,253.00	490,211,253.00
未分配利润	6.4.7.10	22,375,396.38	4,090,427.68
所有者权益合计		182,586,649.38	494,301,680.68
负债和所有者权益总计		183,524,481.32	518,236,156.89

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1397 元，基金份额总额 160,211,253.00 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		41,487,686.60
1. 利息收入		143,387.99
其中：存款利息收入	6.4.7.11	142,141.49
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		1,246.50
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		33,318,842.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	31,453,108.86
基金投资收益	-	-

债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	375,921.04
股利收益	6.4.7.16	1,489,812.70
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	6,979,261.20
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,046,194.81
减：二、费用		1,915,826.90
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	261,027.62
2. 托管费	6.4.10.2.2	87,009.20
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,408,611.36
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		4,397.36
7. 其他费用	6.4.7.20	154,781.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		39,571,859.70
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		39,571,859.70

注：本产品于 2019 年 11 月 21 日成立，无上年可比期间和数据。

6.3 所有者权益（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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	490,211,253.00	4,090,427.68	494,301,680.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	39,571,859.70	39,571,859.70
三、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）	-330,000,000.00	-21,286,891.00	-351,286,891.00
其中：1. 基金申	170,000,000.00	13,975,072.10	183,975,072.10

购款			
2. 基金赎回款	-500,000,000.00	-35,261,963.10	-535,261,963.10
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	160,211,253.00	22,375,396.38	182,586,649.38

注：本产品于 2019 年 11 月 21 日成立，无上年可比期间和数据。

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>苏波</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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2020]99 号文审核同意，本基金 490,211,253.00 份基金份额于 2020 年 2 月 20 日在深交所挂牌交易。

根据《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》的有关规定，本基金的标的指数为中证 500 指数，投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；主要投资范围为标的指数成份股、备选成份股。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)、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)。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。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。本基金的业绩比较基准为: 中证 500 指数收益率。

本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司以本基金为目标 ETF, 于 2020 年 1 月 15 日募集成立了鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“鹏华中证 500ETF 联接基金”)。鹏华中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金, 投资目标与本基金类似, 将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证 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 2020 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 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以其他负债列示。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风

险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及

基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税（和/或）股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标

的指数同期增长率达到 1%以上时，本基金可以进行收益分配。在符合有关基金收益分配条件的前提下，每次收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	4,004,491.08
定期存款	-
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	-
合计	4,004,491.08

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票	158,268,133.03	168,438,826.03	10,170,693.00
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	158,268,133.03	168,438,826.03	10,170,693.00

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。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020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	10,459,146.67	-	-	
其中：股指期货投资	10,459,146.67	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	10,459,146.67	-	-	

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	586.76

应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	82.12
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	764.01
其他	103.95
合计	1,536.84

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	178,560.67
银行间市场应付交易费用	-
合计	178,560.67

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020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	-
预提费用	84,535.36
应付指数使用费	35,000.00
应退替代款	563,167.79
合计	682,703.15

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	490,211,253.00	490,211,253.00
本期申购	170,000,000.00	170,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-500,000,000.00	-500,000,000.00
- 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	160,211,253.00	160,211,253.00

注：1. 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。

2. 本基金自 2019 年 9 月 9 日至 2019 年 11 月 15 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 490,173,730.00 元。根据《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 37,523.00 元在本基金成立后，折算为 37,523.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

6.4.7.10 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	54,672.26	4,035,755.42	4,090,427.68
本期利润	32,595,638.06	6,976,221.64	39,571,859.70
本期基金份额交易产生的变动数	-16,173,711.20	-5,113,179.80	-21,286,891.00
其中：基金申购款	6,743,018.77	7,232,053.33	13,975,072.10
基金赎回款	-22,916,729.97	-12,345,233.13	-35,261,963.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,476,599.12	5,898,797.26	22,375,396.38

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	131,460.36
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	9,216.51
其他	1,464.62
合计	142,141.49

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	17,513,827.93
股票投资收益——赎回差价收入	13,939,280.93
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	31,453,108.86
----	---------------

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	440,016,631.05
减：卖出股票成本总额	422,502,803.12
买卖股票差价收入	17,513,827.93

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	535,261,963.10
减：现金支付赎回款总额	241,091,350.10
减：赎回股票成本总额	280,231,332.07
赎回差价收入	13,939,280.93

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.15.2 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
	2020年1月1日至2020年6月30日
股指期货投资收益	375,921.04

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,489,812.70
其中：证券出借权益补偿收	-

入	
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,489,812.70

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	6,134,937.58
股票投资	6,134,937.58
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	869,653.33
权证投资	-
期货	869,653.33
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	25,329.71
合计	6,979,261.20

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,046,194.81
合计	1,046,194.81

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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	1,408,611.36
银行间市场交易费用	-
合计	1,408,611.36

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	246.00
指数使用费	70,000.00
合计	154,781.36

6.4.7.21 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”）	基金的一级交易商、基金管理人的股东

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

本基金基金合同于 2019 年 11 月 21 日生效，截至本报告期末不满一年，无上年度可比期间数据。

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)

国信证券	469,296,540.91	48.88
------	----------------	-------

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 2020年1月1日至2020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	427,677.60	49.65	-	-

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我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 2020年1月1日至2020年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	37,364.95

注：1、支付基金管理人鹏华基金管理有限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。

3、本基金合同生效日起至本报告期末未满一年，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	87,009.20

注：1、支付基金托管人中国工商银行的托管费年费率为 0.05%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.05%÷当年天数。

2、本基金合同生效日起至本报告期末未满一年，故无上年度可比期间数据。

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

关联方名称	本期			
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日			
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	2,030,220.00	1,283.84	1,248,300.00	764.01

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

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 2020年6月30日		上年度末 2019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 (%)
国信证券	-	-	48,096.00	0.01

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 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	4,004,491.08	131,460.36

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在报告期内未参与关联方承销的证券。

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(2020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	可流通 日	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
002500	山西 证券	2020年 6月29 日	2020年 7月10 日	配股未 上市	5.00	6.54	19,290	96,450.00	126,156.60	-

300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股未上市	36.18	36.18	2,405	87,012.90	87,012.90	-
688277	天智航-U	2020年6月24日	2020年7月7日	新股未上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688318	财富趋势	2020年4月17日	2020年10月27日	锁定期股票	107.41	237.93	2,439	261,972.99	580,311.27	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2021年01月08日	新股未上市	16.42	16.42	5,652	92,805.84	92,805.84	-
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新股未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688568	中科星图	2020年6月30日	2021年01月08日	新股未上市	16.21	16.21	6,818	110,519.78	110,519.78	-
688600	皖仪科技	2020年6月23日	2021年01月04日	锁定期股票	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-

注：1、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。

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	停牌日	停牌原	期末	复牌	复牌	数量	期末	期末	备注
------	----	-----	-----	----	----	----	----	----	----	----

码	名称	期	因	估值单 价	日期	开盘单 价	(股)	成本总额	估值总额	
601880	大连 港	2020年 6月22 日	重大事 项	1.72	2020 年7月 8日	1.89	105,800	197,818.32	181,976.00	-
002470	*ST金 正	2020年 6月30 日	重大事 项	2.27	2020 年7月 1日	2.16	56,000	147,146.07	127,120.00	-

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

合约 编号	证券 代码	证券名称	成交时间	出借到期 日	期末估值 单价	数量（单 位：股）	期末估 值总额
2020 0617 0000 0377	000009	中国宝安	2020年6月 17日	2020年7 月1日	8.51	14,000	119,140 .00
2020 0617 0000 3182	002131	利欧股份	2020年6月 17日	2020年7 月1日	3.86	24,000	92,640. 00
2020 0617 0000 4646	002340	格林美	2020年6月 17日	2020年7 月1日	4.97	21,000	104,370 .00
2020 0617 0000 4871	002385	大北农	2020年6月 17日	2020年7 月1日	9.11	14,000	127,540 .00
2020 0617 0000 5107	002465	海格通信	2020年6月 17日	2020年7 月1日	12.94	10,000	129,400 .00
2020	002505	大康农业	2020年6月	2020年7	2.25	14,000	31,500.

0617 0000 5159			17 日	月 1 日			00
2020 0617 0000 5831	300182	捷成股份	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 1 日	3.99	10,000	39,900. 00
2020 0617 0000 5993	300315	掌趣科技	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 1 日	7.33	15,000	109,950 .00
2020 0617 0000 1749	600166	福田汽车	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 1 日	1.80	24,000	43,200. 00
2020 0617 0000 2100	600415	小商品城	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 1 日	4.87	15,000	73,050. 00
2020 0617 0000 2591	600572	康恩贝	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 1 日	5.50	10,000	55,000. 00
2020 0617 0000 3671	600777	新潮能源	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 1 日	1.52	22,000	33,440. 00
2020 0617 0000 3667	600811	东方集团	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 1 日	4.42	16,000	70,720. 00
2020 0617 0000 4425	600839	四川长虹	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 1 日	2.87	20,000	57,400. 00
2020 0617 0000 3386	601128	常熟银行	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 1 日	7.51	15,000	112,650 .00
2020 0617 0000 2544	601179	中国西电	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 1 日	4.84	10,000	48,400. 00
合计	-	-	-	-	-	254,000	1,248,3 00.00

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人

的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

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所持金融工具变现的难易程度。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 2020 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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%。

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主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，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 2020 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	4,004,491.08	-	-	-	4,004,491.08
结算备付金	9,074,860.14	-	-	-	9,074,860.14
存出保证金	1,616,074.50	-	-	-	1,616,074.50
交易性金融资产	-	-	-	168,438,826.03	168,438,826.03
应收利息	-	-	-	1,536.84	1,536.84
应收股利	-	-	-	500.00	500.00
应收证券清算款	-	-	-	388,192.73	388,192.73
资产总计	14,695,425.72	-	-	168,829,055.60	183,524,481.32
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	25,338.76	25,338.76
应付托管费	-	-	-	8,446.25	8,446.25
应付证券清算款	-	-	-	5,230.64	5,230.64
应付交易费用	-	-	-	178,560.67	178,560.67
应交税费	-	-	-	37,552.47	37,552.47
其他负债	-	-	-	682,703.15	682,703.15
负债总计	-	-	-	937,831.94	937,831.94
利率敏感度缺口	14,695,425.72	-	-	-167,891,223.66	182,586,649.38
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	67,972,890.52	-	-	-	67,972,890.52
结算备付金	200,000,000.00	-	-	-	200,000,000.00
交易性金融资产	-	-	-	250,195,482.03	250,195,482.03
应收利息	-	-	-	67,784.34	67,784.34
资产总计	267,972,890.52	-	-	250,263,266.37	518,236,156.89
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	62,553.94	62,553.94
应付托管费	-	-	-	20,851.31	20,851.31
应付证券清算款	-	-	-	23,615,164.60	23,615,164.60

应付交易费用	-	-	-	213,623.75	213,623.75
其他负债	-	-	-	22,282.61	22,282.61
负债总计	-	-	-	23,934,476.21	23,934,476.21
利率敏感度缺口	267,972,890.52	-	-	-226,328,790.16	494,301,680.68

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 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%。

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分券和备选成分券，所面临的其他价格风险来源于标的指数成分券和备选成分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，按照个股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分券及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股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%。

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 2020年6月30日		上年度末 2019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	168,438,826.03	92.25	250,195,482.03	50.62
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	168,438,826.03	92.25	250,195,482.03	50.62

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

注：于 2020 年 6 月 30 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此，无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 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	168,438,826.03	91.78
	其中：股票	168,438,826.03	91.78
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	13,079,351.22	7.13
8	其他各项资产	2,006,304.07	1.09
9	合计	183,524,481.32	100.00

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 5.2.1 的合计项不含可退替代款估值增值；

2、报告期末基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值及占基金资产净值比例为 0.68%

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	1,500,279.00	0.82
B	采矿业	3,907,434.50	2.14
C	制造业	97,340,167.67	53.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,814,930.20	2.09
E	建筑业	2,164,379.00	1.19
F	批发和零售业	9,287,717.40	5.09
G	交通运输、仓储和邮政业	3,505,907.40	1.92
H	住宿和餐饮业	565,003.00	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,782,301.20	10.29
J	金融业	8,602,436.39	4.71
K	房地产业	5,814,799.60	3.18

L	租赁和商务服务业	3,402,258.00	1.86
M	科学研究和技术服务业	1,212,514.72	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	1,672,997.00	0.92
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	167,256.00	0.09
Q	卫生和社会工作	1,220,540.00	0.67
R	文化、体育和娱乐业	2,610,365.00	1.43
S	综合	1,503,719.00	0.82
	合计	167,075,005.08	91.50

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	648,126.01	0.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
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	702,928.62	0.38
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,363,820.95	0.75

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	300253	卫宁健康	58,080	1,332,355.20	0.73
2	002127	南极电商	58,500	1,238,445.00	0.68
3	002821	凯莱英	4,600	1,117,800.00	0.61
4	600201	生物股份	38,386	1,068,666.24	0.59
5	002185	华天科技	74,600	1,009,338.00	0.55
6	600739	辽宁成大	52,100	986,253.00	0.54
7	600529	山东药玻	16,300	945,400.00	0.52
8	002439	启明星辰	22,200	933,954.00	0.51
9	300088	长信科技	83,100	930,720.00	0.51
10	002385	大北农	100,000	911,000.00	0.50
11	300558	贝达药业	6,500	909,870.00	0.50
12	300012	华测检测	45,247	894,080.72	0.49
13	002131	利欧股份	229,700	886,642.00	0.49
14	600079	人福医药	32,400	881,928.00	0.48
15	300285	国瓷材料	26,100	874,611.00	0.48
16	600521	华海药业	24,858	843,431.94	0.46
17	600298	安琪酵母	16,900	836,212.00	0.46
18	603444	吉比特	1,500	823,515.00	0.45
19	002465	海格通信	63,000	815,220.00	0.45
20	600161	天坛生物	17,900	811,407.00	0.44
21	600143	金发科技	61,400	808,638.00	0.44
22	300496	中科创达	9,700	753,690.00	0.41
23	002075	沙钢股份	60,200	752,500.00	0.41
24	000009	中国宝安	87,800	747,178.00	0.41
25	603517	绝味食品	10,500	742,770.00	0.41
26	002223	鱼跃医疗	20,400	742,560.00	0.41
27	601099	太平洋	232,400	736,708.00	0.40
28	002212	南洋股份	27,500	730,950.00	0.40
29	300595	欧普康视	10,500	728,070.00	0.40
30	300482	万孚生物	7,000	728,000.00	0.40
31	002074	国轩高科	26,800	719,312.00	0.39
32	000636	风华高科	24,400	712,236.00	0.39
33	002273	水晶光电	41,400	709,596.00	0.39
34	300207	欣旺达	37,400	706,860.00	0.39

35	601128	常熟银行	93,500	702,185.00	0.38
36	603882	金城医学	7,800	698,100.00	0.38
37	300418	昆仑万维	27,800	693,888.00	0.38
38	300315	掌趣科技	93,700	686,821.00	0.38
39	600426	华鲁恒升	38,800	685,984.00	0.38
40	002507	涪陵榨菜	18,700	673,387.00	0.37
41	300357	我武生物	10,800	672,300.00	0.37
42	000988	华工科技	27,300	666,939.00	0.37
43	603939	益丰药房	7,220	657,020.00	0.36
44	002340	格林美	130,400	648,088.00	0.35
45	000975	银泰黄金	40,700	638,176.00	0.35
46	002603	以岭药业	20,400	636,276.00	0.35
47	002414	高德红外	21,680	634,790.40	0.35
48	300212	易华录	11,200	627,200.00	0.34
49	300271	华宇软件	22,100	623,441.00	0.34
50	300168	万达信息	28,200	622,374.00	0.34
51	002373	千方科技	25,500	611,745.00	0.34
52	600885	宏发股份	15,200	609,824.00	0.33
53	600132	重庆啤酒	8,300	605,900.00	0.33
54	600699	均胜电子	25,400	604,774.00	0.33
55	002353	杰瑞股份	19,500	604,500.00	0.33
56	000513	丽珠集团	12,500	600,125.00	0.33
57	000547	航天发展	43,700	597,379.00	0.33
58	600859	王府井	13,100	596,705.00	0.33
59	002156	通富微电	23,600	591,180.00	0.32
60	601799	星宇股份	4,600	584,200.00	0.32
61	300009	安科生物	32,610	583,719.00	0.32
62	002019	亿帆医药	25,400	583,438.00	0.32
63	300024	机器人	42,400	579,608.00	0.32
64	002797	第一创业	83,600	578,512.00	0.32
65	002557	洽洽食品	10,500	568,995.00	0.31
66	002030	达安基因	20,810	567,696.80	0.31
67	000750	国海证券	129,900	563,766.00	0.31
68	300017	网宿科技	66,300	562,887.00	0.31
69	603858	步长制药	19,300	556,805.00	0.30
70	002250	联化科技	25,300	551,540.00	0.30
71	600801	华新水泥	23,200	550,072.00	0.30
72	000021	深科技	25,100	547,933.00	0.30
73	002195	二三四五	194,900	547,669.00	0.30
74	002500	山西证券	83,590	546,678.60	0.30
75	002138	顺络电子	21,900	546,405.00	0.30
76	603233	大参林	6,720	545,798.40	0.30

77	300316	晶盛机电	21,900	541,806.00	0.30
78	600315	上海家化	11,300	541,270.00	0.30
79	600380	健康元	33,300	540,792.00	0.30
80	000050	深天马 A	34,800	534,528.00	0.29
81	600895	张江高科	26,200	533,694.00	0.29
82	002152	广电运通	41,200	533,128.00	0.29
83	300058	蓝色光标	68,000	530,400.00	0.29
84	002174	游族网络	20,300	529,424.00	0.29
85	300070	碧水源	64,600	524,552.00	0.29
86	002572	索菲亚	21,700	524,489.00	0.29
87	000998	隆平高科	31,400	522,810.00	0.29
88	300244	迪安诊断	14,800	522,440.00	0.29
89	600845	宝信软件	8,800	519,904.00	0.28
90	600486	扬农化工	6,300	519,750.00	0.28
91	000401	冀东水泥	32,200	516,488.00	0.28
92	600410	华胜天成	37,400	508,640.00	0.28
93	600667	太极实业	42,900	507,078.00	0.28
94	600037	歌华有线	33,300	506,160.00	0.28
95	002078	太阳纸业	52,900	503,608.00	0.28
96	600535	天士力	31,000	502,820.00	0.28
97	000623	吉林敖东	31,800	500,214.00	0.27
98	603338	浙江鼎力	6,600	500,082.00	0.27
99	300274	阳光电源	34,600	497,894.00	0.27
100	002382	蓝帆医疗	16,500	496,815.00	0.27
101	600642	申能股份	83,800	495,258.00	0.27
102	600155	华创阳安	41,301	495,198.99	0.27
103	002511	中顺洁柔	22,200	495,060.00	0.27
104	002690	美亚光电	9,300	489,180.00	0.27
105	002396	星网锐捷	13,800	487,554.00	0.27
106	002013	中航机电	61,600	486,640.00	0.27
107	000630	铜陵有色	250,800	484,044.00	0.27
108	601233	桐昆股份	37,700	481,052.00	0.26
109	600126	杭钢股份	46,100	479,440.00	0.26
110	600879	航天电子	74,100	477,204.00	0.26
111	002926	华西证券	44,700	475,161.00	0.26
112	603707	健友股份	7,300	471,361.00	0.26
113	600153	建发股份	57,800	468,180.00	0.26
114	000739	普洛药业	20,000	465,800.00	0.26
115	300010	立思辰	23,700	463,809.00	0.25
116	600884	杉杉股份	38,865	458,218.35	0.25
117	002281	光迅科技	13,800	453,468.00	0.25
118	600415	小商品城	92,900	452,423.00	0.25

119	600167	联美控股	31,200	447,408.00	0.25
120	600811	东方集团	100,900	445,978.00	0.24
121	603659	璞泰来	4,300	442,986.00	0.24
122	600216	浙江医药	23,000	442,980.00	0.24
123	001914	招商积余	14,400	442,512.00	0.24
124	300251	光线传媒	40,100	437,491.00	0.24
125	600804	鹏博士	48,600	436,428.00	0.24
126	600728	佳都科技	47,800	435,458.00	0.24
127	300115	长盈精密	18,700	427,295.00	0.23
128	300001	特锐德	20,300	425,082.00	0.23
129	002268	卫士通	19,900	424,666.00	0.23
130	600511	国药股份	10,400	422,968.00	0.23
131	002028	思源电气	20,600	421,476.00	0.23
132	002294	信立泰	14,200	421,172.00	0.23
133	600909	华安证券	61,600	420,728.00	0.23
134	300002	神州泰岳	66,600	412,254.00	0.23
135	600779	水井坊	6,600	411,972.00	0.23
136	000581	威孚高科	19,800	409,464.00	0.22
137	600325	华发股份	57,600	406,656.00	0.22
138	000686	东北证券	47,900	404,755.00	0.22
139	000997	新大陆	25,100	401,098.00	0.22
140	600528	中铁工业	45,400	400,428.00	0.22
141	601689	拓普集团	14,300	398,970.00	0.22
142	002387	维信诺	27,900	398,412.00	0.22
143	600418	江淮汽车	45,100	398,233.00	0.22
144	600446	金证股份	20,400	395,760.00	0.22
145	002242	九阳股份	10,600	395,062.00	0.22
146	600827	百联股份	27,200	393,040.00	0.22
147	600460	士兰微	26,700	391,956.00	0.21
148	600598	北大荒	24,300	391,230.00	0.21
149	000999	华润三九	13,300	388,227.00	0.21
150	600959	江苏有线	102,000	383,520.00	0.21
151	600733	北汽蓝谷	59,400	381,942.00	0.21
152	002317	众生药业	22,200	380,952.00	0.21
153	603883	老百姓	3,800	380,152.00	0.21
154	603605	珀莱雅	2,100	378,042.00	0.21
155	603806	福斯特	7,523	375,472.93	0.21
156	601168	西部矿业	64,700	375,260.00	0.21
157	600256	广汇能源	138,400	373,680.00	0.20
158	002368	太极股份	8,500	371,365.00	0.20
159	603000	人民网	18,700	370,821.00	0.20
160	603568	伟明环保	15,920	369,344.00	0.20

161	300296	利亚德	60,700	368,449.00	0.20
162	000564	供销大集	81,800	367,282.00	0.20
163	000878	云南铜业	34,600	367,106.00	0.20
164	600260	凯乐科技	27,100	366,392.00	0.20
165	002670	国盛金控	39,600	362,340.00	0.20
166	600820	隧道股份	64,100	362,165.00	0.20
167	600704	物产中大	86,000	362,060.00	0.20
168	600839	四川长虹	125,400	359,898.00	0.20
169	002081	金螳螂	45,700	359,202.00	0.20
170	300113	顺网科技	14,100	358,140.00	0.20
171	600497	驰宏锌锗	103,700	356,728.00	0.20
172	300166	东方国信	28,700	356,167.00	0.20
173	600673	东阳光	51,300	354,483.00	0.19
174	002080	中材科技	22,800	353,400.00	0.19
175	002124	天邦股份	27,500	353,375.00	0.19
176	600008	首创股份	116,000	349,160.00	0.19
177	600572	康恩贝	63,300	348,150.00	0.19
178	300630	普利制药	4,700	347,565.00	0.19
179	002221	东华能源	39,500	347,205.00	0.19
180	000158	常山北明	32,800	342,432.00	0.19
181	603866	桃李面包	6,700	340,963.00	0.19
182	600718	东软集团	29,600	340,400.00	0.19
183	600549	厦门钨业	28,700	339,808.00	0.19
184	300026	红日药业	61,500	339,480.00	0.19
185	601179	中国西电	69,900	338,316.00	0.19
186	002920	德赛西威	5,500	337,315.00	0.18
187	000800	一汽解放	31,400	337,236.00	0.18
188	300618	寒锐钴业	5,400	334,908.00	0.18
189	600875	东方电气	37,800	334,530.00	0.18
190	002217	合力泰	63,400	332,850.00	0.18
191	601966	玲珑轮胎	16,410	331,482.00	0.18
192	600171	上海贝岭	19,000	330,220.00	0.18
193	000729	燕京啤酒	48,100	329,485.00	0.18
194	600021	上海电力	44,500	329,300.00	0.18
195	002831	裕同科技	11,800	324,618.00	0.18
196	600060	海信视像	26,600	323,190.00	0.18
197	600094	大名城	54,300	323,085.00	0.18
198	600567	山鹰纸业	109,500	323,025.00	0.18
199	600881	亚泰集团	110,700	322,137.00	0.18
200	000877	天山股份	21,300	321,630.00	0.18
201	600862	中航高科	18,900	319,788.00	0.18
202	600645	中源协和	11,272	318,434.00	0.17

203	002399	海普瑞	12,700	318,008.00	0.17
204	002709	天赐材料	9,400	317,626.00	0.17
205	000060	中金岭南	85,300	317,316.00	0.17
206	600160	巨化股份	46,000	316,940.00	0.17
207	002056	横店东磁	27,800	312,750.00	0.17
208	600597	光明乳业	20,800	309,088.00	0.17
209	000090	天健集团	44,500	307,495.00	0.17
210	603228	景旺电子	8,720	306,856.80	0.17
211	002429	兆驰股份	61,700	305,415.00	0.17
212	600754	锦江酒店	11,000	305,250.00	0.17
213	600026	中远海能	47,200	304,912.00	0.17
214	002458	益生股份	19,900	303,873.00	0.17
215	603712	七一二	7,909	303,547.42	0.17
216	300133	华策影视	41,700	302,325.00	0.17
217	600967	内蒙一机	28,700	298,193.00	0.16
218	601005	重庆钢铁	200,100	298,149.00	0.16
219	600273	嘉化能源	34,000	297,160.00	0.16
220	600580	卧龙电驱	26,400	296,736.00	0.16
221	002648	卫星石化	18,200	296,114.00	0.16
222	600392	盛和资源	41,700	293,985.00	0.16
223	000629	攀钢钒钛	146,100	293,661.00	0.16
224	002233	塔牌集团	24,400	293,532.00	0.16
225	600282	南钢股份	90,600	292,638.00	0.16
226	002203	海亮股份	33,400	292,250.00	0.16
227	002807	江阴银行	74,100	291,213.00	0.16
228	000960	锡业股份	34,000	291,040.00	0.16
229	002004	华邦健康	54,000	290,520.00	0.16
230	600755	厦门国贸	44,000	290,400.00	0.16
231	002085	万丰奥威	44,700	289,656.00	0.16
232	600039	四川路桥	75,700	289,174.00	0.16
233	600064	南京高科	29,500	286,740.00	0.16
234	600566	济川药业	11,200	285,152.00	0.16
235	000970	中科三环	29,000	283,620.00	0.16
236	600737	中粮糖业	36,400	283,192.00	0.16
237	600195	中牧股份	17,400	282,402.00	0.15
238	601118	海南橡胶	58,100	282,366.00	0.15
239	600166	福田汽车	156,600	281,880.00	0.15
240	000598	兴蓉环境	61,100	281,060.00	0.15
241	601975	招商南油	117,400	280,586.00	0.15
242	300182	捷成股份	70,200	280,098.00	0.15
243	000778	新兴铸管	81,600	279,888.00	0.15
244	000690	宝新能源	59,100	278,952.00	0.15

245	600563	法拉电子	4,500	278,100.00	0.15
246	600515	海航基础	53,400	277,680.00	0.15
247	002110	三钢闽光	41,600	277,056.00	0.15
248	300324	旋极信息	41,600	277,056.00	0.15
249	600466	蓝光发展	51,400	277,046.00	0.15
250	603816	顾家家居	6,100	274,561.00	0.15
251	002635	安洁科技	11,000	273,900.00	0.15
252	600373	中文传媒	23,200	273,296.00	0.15
253	002506	协鑫集成	104,100	271,701.00	0.15
254	000402	金融街	40,900	271,576.00	0.15
255	000400	许继电气	20,500	270,600.00	0.15
256	002745	木林森	17,500	269,675.00	0.15
257	300474	景嘉微	4,000	269,200.00	0.15
258	002038	双鹭药业	21,000	269,010.00	0.15
259	600435	北方导航	35,500	268,380.00	0.15
260	000967	盈峰环境	32,500	268,125.00	0.15
261	000089	深圳机场	34,900	267,334.00	0.15
262	002191	劲嘉股份	30,000	267,300.00	0.15
263	002925	盈趣科技	4,600	266,524.00	0.15
264	002048	宁波华翔	17,200	265,568.00	0.15
265	002092	中泰化学	58,500	265,005.00	0.15
266	601860	紫金银行	62,600	264,798.00	0.15
267	600643	爱建集团	33,300	264,735.00	0.14
268	000681	视觉中国	14,200	264,404.00	0.14
269	000738	航发控制	19,300	263,445.00	0.14
270	002595	豪迈科技	13,500	262,710.00	0.14
271	601106	中国一重	93,400	262,454.00	0.14
272	000983	西山煤电	69,970	262,387.50	0.14
273	600729	重庆百货	8,400	262,248.00	0.14
274	600808	马钢股份	101,600	262,128.00	0.14
275	000039	中集集团	36,200	261,726.00	0.14
276	600120	浙江东方	37,920	260,510.40	0.14
277	002183	怡亚通	48,600	260,496.00	0.14
278	000830	鲁西化工	34,900	260,354.00	0.14
279	601098	中南传媒	24,600	260,268.00	0.14
280	000930	中粮科技	38,100	260,223.00	0.14
281	601333	广深铁路	115,600	260,100.00	0.14
282	600258	首旅酒店	16,900	259,753.00	0.14
283	600056	中国医药	18,300	258,945.00	0.14
284	000825	太钢不锈	77,800	258,296.00	0.14
285	600633	浙数文化	26,400	258,192.00	0.14
286	600376	首开股份	43,800	256,668.00	0.14

287	600388	龙净环保	29,100	256,080.00	0.14
288	600649	城投控股	43,100	256,014.00	0.14
289	600675	中华企业	62,500	254,375.00	0.14
290	000415	渤海租赁	84,000	250,320.00	0.14
291	000563	陕国投 A	67,300	249,683.00	0.14
292	002407	多氟多	23,400	248,976.00	0.14
293	601866	中远海发	135,300	248,952.00	0.14
294	002372	伟星新材	21,400	248,882.00	0.14
295	002839	张家港行	43,200	248,832.00	0.14
296	300180	华峰超纤	29,000	248,240.00	0.14
297	601718	际华集团	74,600	247,672.00	0.14
298	000501	鄂武商 A	15,700	246,176.00	0.13
299	600776	东方通信	16,300	245,967.00	0.13
300	002010	传化智联	44,500	242,080.00	0.13
301	002640	跨境通	37,200	241,428.00	0.13
302	002815	崇达技术	11,900	240,737.00	0.13
303	002064	华峰氨纶	47,300	239,811.00	0.13
304	600022	山东钢铁	185,900	239,811.00	0.13
305	000012	南玻 A	47,600	238,952.00	0.13
306	603077	和邦生物	180,900	238,788.00	0.13
307	002583	海能达	31,400	238,326.00	0.13
308	600500	中化国际	47,100	238,326.00	0.13
309	000932	华菱钢铁	62,800	236,756.00	0.13
310	000078	海王生物	56,200	235,478.00	0.13
311	600062	华润双鹤	17,800	235,316.00	0.13
312	002375	亚厦股份	22,900	234,038.00	0.13
313	000883	湖北能源	66,400	233,728.00	0.13
314	600266	城建发展	46,080	233,625.60	0.13
315	000807	云铝股份	53,400	232,824.00	0.13
316	000685	中山公用	30,200	232,540.00	0.13
317	000959	首钢股份	54,000	232,200.00	0.13
318	601615	明阳智能	18,600	231,570.00	0.13
319	603486	科沃斯	7,640	230,804.40	0.13
320	600316	洪都航空	14,600	230,680.00	0.13
321	000301	东方盛虹	41,300	229,628.00	0.13
322	000559	万向钱潮	47,100	227,964.00	0.12
323	002936	郑州银行	66,110	227,418.40	0.12
324	000027	深圳能源	48,880	226,803.20	0.12
325	002244	滨江集团	53,100	226,737.00	0.12
326	601699	潞安环能	40,700	226,699.00	0.12
327	601000	唐山港	101,400	226,122.00	0.12
328	002155	湖南黄金	28,600	225,368.00	0.12

329	000488	晨鸣纸业	45,600	225,264.00	0.12
330	000028	国药一致	5,000	225,050.00	0.12
331	000519	中兵红箭	23,700	223,254.00	0.12
332	000031	大悦城	43,800	222,942.00	0.12
333	000528	柳工	35,100	221,481.00	0.12
334	600782	新钢股份	54,200	221,136.00	0.12
335	600640	号百控股	11,000	219,450.00	0.12
336	002444	巨星科技	18,400	218,592.00	0.12
337	000987	越秀金控	18,600	216,876.00	0.12
338	600908	无锡银行	44,100	216,531.00	0.12
339	002440	闰土股份	23,600	215,704.00	0.12
340	002266	浙富控股	54,900	212,463.00	0.12
341	002625	光启技术	29,300	212,425.00	0.12
342	600073	上海梅林	22,300	211,627.00	0.12
343	600777	新潮能源	138,900	211,128.00	0.12
344	000156	华数传媒	19,300	209,019.00	0.11
345	601717	郑煤机	35,400	208,506.00	0.11
346	002390	信邦制药	45,300	206,568.00	0.11
347	300072	三聚环保	48,200	206,296.00	0.11
348	601958	金钼股份	33,200	205,176.00	0.11
349	600312	平高电气	27,600	204,792.00	0.11
350	601608	中信重工	59,200	202,464.00	0.11
351	600291	西水股份	22,300	201,815.00	0.11
352	002701	奥瑞金	48,100	201,539.00	0.11
353	300459	金科文化	58,300	201,135.00	0.11
354	002424	贵州百灵	24,200	200,860.00	0.11
355	000898	鞍钢股份	81,700	200,165.00	0.11
356	000046	泛海控股	52,900	199,433.00	0.11
357	002434	万里扬	22,800	197,904.00	0.11
358	000758	中色股份	47,000	196,460.00	0.11
359	000887	中鼎股份	24,900	195,465.00	0.11
360	600409	三友化工	41,900	195,254.00	0.11
361	600863	内蒙华电	79,300	195,078.00	0.11
362	600557	康缘药业	14,000	194,880.00	0.11
363	002505	大康农业	86,500	194,625.00	0.11
364	000008	神州高铁	66,100	194,334.00	0.11
365	600765	中航重机	19,000	194,180.00	0.11
366	600138	中青旅	19,600	193,452.00	0.11
367	601228	广州港	63,600	193,344.00	0.11
368	002563	森马服饰	27,400	193,170.00	0.11
369	600751	海航科技	61,200	191,556.00	0.10
370	002589	瑞康医药	35,700	191,352.00	0.10

371	600507	方大特钢	36,771	190,841.49	0.10
372	002002	鸿达兴业	52,700	190,247.00	0.10
373	000712	锦龙股份	15,200	190,000.00	0.10
374	000813	德展健康	30,500	189,100.00	0.10
375	600158	中体产业	23,100	188,958.00	0.10
376	600970	中材国际	35,600	187,968.00	0.10
377	600835	上海机电	11,100	187,923.00	0.10
378	601200	上海环境	15,600	187,200.00	0.10
379	600478	科力远	39,300	185,103.00	0.10
380	600259	广晟有色	6,100	183,000.00	0.10
381	600545	卓郎智能	38,600	182,578.00	0.10
382	600639	浦东金桥	11,400	182,172.00	0.10
383	601880	大连港	105,800	181,976.00	0.10
384	000826	启迪环境	24,500	181,790.00	0.10
385	300134	大富科技	13,000	181,740.00	0.10
386	603885	吉祥航空	19,900	181,090.00	0.10
387	600717	天津港	40,920	180,866.40	0.10
388	603198	迎驾贡酒	8,200	178,514.00	0.10
389	002503	搜于特	63,500	178,435.00	0.10
390	600648	外高桥	12,600	178,164.00	0.10
391	601928	凤凰传媒	26,200	178,160.00	0.10
392	002249	大洋电机	48,500	175,085.00	0.10
393	600125	铁龙物流	31,300	174,654.00	0.10
394	601598	中国外运	54,000	174,420.00	0.10
395	600348	阳泉煤业	40,900	172,598.00	0.09
396	000061	农产品	23,200	171,912.00	0.09
397	000732	泰禾集团	33,700	171,533.00	0.09
398	600329	中新药业	9,900	171,468.00	0.09
399	600823	世茂股份	38,200	170,754.00	0.09
400	002665	首航高科	68,900	168,116.00	0.09
401	603377	东方时尚	10,100	167,256.00	0.09
402	002901	大博医疗	1,400	167,006.00	0.09
403	601611	中国核建	27,000	166,860.00	0.09
404	002867	周大生	7,500	166,275.00	0.09
405	002302	西部建设	17,200	165,120.00	0.09
406	600307	酒钢宏兴	107,100	164,934.00	0.09
407	600582	天地科技	56,100	164,373.00	0.09
408	300376	易事特	31,600	164,320.00	0.09
409	000990	诚志股份	12,700	161,163.00	0.09
410	600748	上实发展	31,400	160,454.00	0.09
411	600901	江苏租赁	30,600	159,426.00	0.09
412	000718	苏宁环球	51,500	159,135.00	0.09

413	600017	日照港	63,300	157,617.00	0.09
414	600141	兴发集团	17,600	157,520.00	0.09
415	600664	哈药股份	51,100	157,388.00	0.09
416	000062	深圳华强	10,800	157,032.00	0.09
417	002419	天虹股份	16,400	156,620.00	0.09
418	603888	新华网	7,000	156,520.00	0.09
419	000717	韶钢松山	41,000	155,800.00	0.09
420	601678	滨化股份	36,700	155,608.00	0.09
421	000543	皖能电力	38,500	154,770.00	0.08
422	000848	承德露露	22,110	154,770.00	0.08
423	002544	杰赛科技	11,700	153,855.00	0.08
424	000869	张裕A	4,500	153,675.00	0.08
425	600277	亿利洁能	46,800	152,568.00	0.08
426	002093	国脉科技	17,200	152,220.00	0.08
427	002416	爱施德	21,100	151,498.00	0.08
428	002128	露天煤业	19,500	151,125.00	0.08
429	002408	齐翔腾达	24,300	150,903.00	0.08
430	600869	智慧能源	37,700	150,800.00	0.08
431	300257	开山股份	11,500	150,305.00	0.08
432	002653	海思科	5,400	143,694.00	0.08
433	002948	青岛银行	27,900	142,011.00	0.08
434	300197	铁汉生态	55,900	141,986.00	0.08
435	603328	依顿电子	13,600	141,848.00	0.08
436	000553	安道麦A	15,600	140,712.00	0.08
437	600565	迪马股份	49,500	138,105.00	0.08
438	000537	广宇发展	18,900	137,970.00	0.08
439	603983	丸美股份	1,600	137,648.00	0.08
440	603650	彤程新材	5,900	137,293.00	0.08
441	603515	欧普照明	5,000	136,850.00	0.07
442	603766	隆鑫通用	34,700	134,289.00	0.07
443	603056	德邦股份	9,900	133,947.00	0.07
444	601019	山东出版	21,300	133,125.00	0.07
445	002491	通鼎互联	25,800	132,096.00	0.07
446	600787	中储股份	29,800	130,822.00	0.07
447	600350	山东高速	21,200	130,168.00	0.07
448	600339	中油工程	56,900	129,163.00	0.07
449	600053	九鼎投资	4,300	128,312.00	0.07
450	600770	综艺股份	26,600	127,680.00	0.07
451	603317	天味食品	2,295	127,556.10	0.07
452	002470	*ST金正	56,000	127,120.00	0.07
453	601139	深圳燃气	19,400	126,100.00	0.07
454	000600	建投能源	24,300	123,687.00	0.07

455	601869	长飞光纤	4,000	123,240.00	0.07
456	002051	中工国际	16,900	123,032.00	0.07
457	600338	西藏珠峰	12,300	123,000.00	0.07
458	603786	科博达	1,600	120,560.00	0.07
459	601016	节能风电	56,800	120,416.00	0.07
460	600657	信达地产	29,200	120,304.00	0.07
461	600694	大商股份	4,900	117,551.00	0.06
462	002118	紫鑫药业	26,400	117,216.00	0.06
463	002285	世联行	41,600	116,064.00	0.06
464	600985	淮北矿业	14,800	115,292.00	0.06
465	601801	皖新传媒	20,400	113,424.00	0.06
466	600428	中远海特	36,600	112,728.00	0.06
467	600707	彩虹股份	24,600	112,176.00	0.06
468	600575	淮河能源	53,100	110,979.00	0.06
469	600006	东风汽车	27,300	110,019.00	0.06
470	000937	冀中能源	35,900	108,418.00	0.06
471	600757	长江传媒	20,600	104,854.00	0.06
472	601865	福莱特	5,500	103,400.00	0.06
473	600996	贵广网络	14,200	101,246.00	0.06
474	600874	创业环保	14,900	98,936.00	0.05
475	600623	华谊集团	18,900	97,524.00	0.05
476	603556	海兴电力	6,700	96,748.00	0.05
477	002941	新疆交建	6,600	93,390.00	0.05
478	600058	五矿发展	14,600	88,184.00	0.05
479	603868	飞科电器	1,700	83,861.00	0.05
480	000785	居然之家	10,300	81,576.00	0.04
481	601003	柳钢股份	17,500	77,525.00	0.04
482	600903	贵州燃气	7,800	76,752.00	0.04
483	002946	新乳业	4,300	74,605.00	0.04
484	601127	小康股份	8,800	73,128.00	0.04
485	000025	特力A	3,900	71,487.00	0.04
486	603355	莱克电气	2,800	69,692.00	0.04
487	600335	国机汽车	14,800	68,376.00	0.04
488	603379	三美股份	3,040	65,268.80	0.04
489	601969	海南矿业	13,300	64,904.00	0.04
490	601512	中新集团	5,500	63,250.00	0.03
491	002818	富森美	5,100	62,730.00	0.03
492	603225	新凤鸣	5,600	55,888.00	0.03
493	001872	招商港口	3,800	55,290.00	0.03
494	002423	中粮资本	6,300	54,810.00	0.03
495	601811	新华文轩	5,300	53,901.00	0.03
496	603025	大豪科技	6,200	45,074.00	0.02

497	600917	重庆燃气	6,300	44,982.00	0.02
498	601068	中铝国际	10,500	41,055.00	0.02
499	603256	宏和科技	3,400	38,896.00	0.02
500	002957	科瑞技术	1,500	35,850.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688318	财富趋势	2,439	580,311.27	0.32
2	688568	中科星图	6,818	110,519.78	0.06
3	688277	天智航-U	8,810	106,072.40	0.06
4	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.05
5	688377	迪威尔	5,652	92,805.84	0.05
6	688027	国盾量子	2,405	87,012.90	0.05
7	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.05
8	603087	甘李药业	753	75,525.90	0.04
9	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
10	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.01
11	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
12	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
13	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
14	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.01
15	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
16	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
17	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
18	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	600745	闻泰科技	6,067,629.00	1.23
2	600584	长电科技	3,648,785.98	0.74
3	002821	凯莱英	3,297,891.00	0.67
4	300088	长信科技	3,088,634.59	0.62
5	601099	太平洋	3,046,054.00	0.62
6	600739	辽宁成大	3,044,307.00	0.62
7	600201	生物股份	2,989,757.23	0.60
8	601128	常熟银行	2,840,789.48	0.57
9	002384	东山精密	2,767,466.00	0.56
10	600763	通策医疗	2,720,277.24	0.55
11	600699	均胜电子	2,644,502.00	0.53

12	601799	星宇股份	2,595,744.00	0.53
13	600426	华鲁恒升	2,590,912.77	0.52
14	002463	沪电股份	2,587,542.58	0.52
15	300014	亿纬锂能	2,533,991.00	0.51
16	002371	北方华创	2,497,491.00	0.51
17	002439	启明星辰	2,404,233.80	0.49
18	002129	中环股份	2,385,010.00	0.48
19	603659	璞泰来	2,368,894.00	0.48
20	000066	中国长城	2,359,029.16	0.48

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	600745	闻泰科技	8,797,783.60	1.78
2	600584	长电科技	5,620,329.54	1.14
3	600763	通策医疗	4,405,442.70	0.89
4	600536	中国软件	3,806,644.00	0.77
5	600201	生物股份	3,754,945.35	0.76
6	601099	太平洋	3,647,973.00	0.74
7	600739	辽宁成大	3,467,206.44	0.70
8	601128	常熟银行	3,258,824.00	0.66
9	600699	均胜电子	3,140,456.72	0.64
10	600426	华鲁恒升	3,018,999.00	0.61
11	600845	宝信软件	3,002,195.52	0.61
12	601799	星宇股份	2,982,761.86	0.60
13	600143	金发科技	2,870,780.74	0.58
14	601100	恒立液压	2,714,742.36	0.55
15	300014	亿纬锂能	2,650,915.47	0.54
16	603659	璞泰来	2,643,808.10	0.53
17	002371	北方华创	2,585,172.00	0.52
18	603939	益丰药房	2,523,311.00	0.51
19	600150	中国船舶	2,515,303.60	0.51
20	601231	环旭电子	2,498,349.21	0.51

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	524,263,086.48
卖出股票收入（成交）总额	440,016,631.05

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代 码	名 称	持仓量 (买/ 卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC2009	IC2009	10	11,328,800.0 0	869,653.33	-
公允价值变动总额合计(元)					869,653.33
股指期货投资本期收益(元)					375,921.04
股指期货投资本期公允价值变动(元)					869,653.33

7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.3 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	1,616,074.50
2	应收证券清算款	388,192.73
3	应收股利	500.00
4	应收利息	1,536.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,006,304.07

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688318	财富趋势	580,311.27	0.32	锁定期股票
2	688568	中科星图	110,519.78	0.06	新股未上市
3	688277	天智航-U	106,072.40	0.06	新股未上市
4	688528	秦川物联	94,458.21	0.05	新股未上市
5	688377	迪威尔	92,805.84	0.05	新股未上市

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 (%)
2,318	69,116.16	88,716,568.00	55.37	71,494,685.00	44.63

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	69,346,236.00	43.28

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	鹏华基金—明珠理财 月月赢系列 2020 年第 11 期—鹏华基金连赢 量化 FOF1 号单一资产 管理计划	9,590,809.00	5.99
2	中信建投证券股份有 限公司	3,290,472.00	2.05
3	白洞明	2,603,138.00	1.62
4	广东省畜牧发展总公 司	2,374,115.00	1.48
5	招商证券股份有限公 司	2,008,279.00	1.25
6	方正证券股份有限公 司	1,842,447.00	1.15
7	杨德凤	1,500,029.00	0.94
8	梁如宾	1,213,022.00	0.76
9	高文苗	1,000,087.00	0.62
10	陆福高	954,000.00	0.60
	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	69,346,236.00	43.28

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	490,211,253.00
本报告期基金总申购份额	170,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	500,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	160,211,253.00

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。

§ 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

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金审计的会计师事务所。本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	2	469,296,540.91	48.88%	427,677.60	49.65%	-
中金公司	1	323,155,668.06	33.66%	294,499.80	34.19%	-
东吴证券	1	96,184,849.65	10.02%	78,035.65	9.06%	-
国盛证券	1	40,813,415.65	4.25%	33,112.26	3.84%	-
中泰证券	1	27,359,427.30	2.85%	24,934.75	2.89%	-
西部证券	2	3,348,345.18	0.35%	3,051.42	0.35%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
华西证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准和程序：

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

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

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性以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

注：无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于旗下证券投资基金招募说明书的补充提示	《上海证券报》	2020 年 01 月 16 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金在蒙商银行股份有限公司暂停办理相关销售业务的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》	2020 年 05 月 23 日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 01 月 17 日

4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 01 月 17 日
5	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	《证券日报》	2020 年 02 月 03 日
6	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《上海证券报》	2020 年 02 月 05 日
7	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《证券日报》	2020 年 02 月 05 日
8	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《证券时报》	2020 年 02 月 05 日
9	鹏华基金管理有限公司关于使用不低于 5000 万元自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	《中国证券报》	2020 年 02 月 05 日
10	关于鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金修改基金合同、托管协议有关条款的公告	《中国证券报》	2020 年 02 月 12 日
11	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书摘要（2020 年第 1 号）	《中国证券报》	2020 年 02 月 17 日
12	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	《中国证券报》	2020 年 02 月 17 日
13	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购赎回业务的公告	《中国证券报》	2020 年 02 月 17 日
14	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	《中国证券报》	2020 年 02 月 20 日
15	关于鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金增加部分证券公司为场内申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》	2020 年 02 月 20 日
16	关于鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	《中国证券报》	2020 年 02 月 20 日
17	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》	2020 年 03 月 25 日
18	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《证券日报》	2020 年 03 月 28 日
19	关于调整鹏华中证 500 交易型开放式	《中国证券报》	2020 年 03 月 28 日

	指数证券投资基金指数许可使用费并修改法律文件的公告		
20	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《中国证券报》	2020 年 03 月 28 日
21	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《证券时报》	2020 年 03 月 28 日
22	鹏华基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《上海证券报》	2020 年 03 月 28 日
23	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书摘要（2020 年第 2 号）	《中国证券报》	2020 年 04 月 01 日
24	关于鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金增加部分证券公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》	2020 年 04 月 10 日
25	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 22 日
26	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《证券时报》	2020 年 04 月 22 日
27	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《证券日报》	2020 年 04 月 22 日
28	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	《中国证券报》	2020 年 04 月 22 日
29	鹏华基金管理有限公司关于结束旗下基金在中信证券华南股份有限公司（原广州证券股份有限公司）申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 04 月 28 日
30	鹏华基金管理有限公司关于结束旗下基金在中信证券华南股份有限公司（原广州证券股份有限公司）申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 04 月 28 日
31	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 05 月 06 日
32	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 05 月 06 日
33	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的	《上海证券报》	2020 年 05 月 06 日

	公告		
34	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华安证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 05 月 06 日
35	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2020 年 05 月 18 日
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 05 月 18 日
37	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券日报》	2020 年 05 月 18 日
38	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万联证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《证券时报》	2020 年 05 月 18 日
39	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与青岛意才基金销售有限公司认、申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2020 年 01 月 17 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	20200221~20200630	-	215,846,236.00	146,500,000.00	69,346,236.00	43.28
个人	-	-	-	-	-	-	-
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、指数分级基金合并份额和红利再投；

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、场内卖出份额和指数分级基金拆分份额。

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 2020 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

2020 年 8 月 31 日