

鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF） 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 27 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	12
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	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	18
§ 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	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56

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	56
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	56
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	56
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	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息.....	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末上市基金前十名持有人	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	61
§ 9 开放式基金份额变动.....	61
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)	
基金简称	鹏华沪深 300 指数 (LOF)	
场内简称	鹏华 300LOF	
基金主代码	160615	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2009 年 4 月 3 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	248,067,724.35 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的 证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2009 年 5 月 8 日	
下属分级基金的基 金简称	鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)	鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)
下属分级基金的交 易代码	160615	006939
报告期末下属分级 基金的份额总额	197,411,056.62 份	50,656,667.73 份

注：无。

2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资方式，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化，力争将日平均跟踪误差控制在 0.35% 以内，以实现沪深 300 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法，按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，

	或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理，使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张戈	郭明
	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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	鹏华沪深 300 指数 A 类(LOF)	鹏华沪深 300 指数 C 类(LOF)

本期已实现收益	40,397,883.39	5,898,345.31
本期利润	16,165,597.21	5,981,067.08
加权平均基金份额本期利润	0.0874	0.1623
本期加权平均净值利润率	3.54%	8.62%
本期基金份额净值增长率	3.13%	3.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	297,154,414.45	29,671,817.14
期末可供分配基金份额利润	1.5053	0.5857
期末基金资产净值	494,565,471.07	96,757,004.38
期末基金份额净值	2.505	1.910
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	162.53%	91.00%

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

鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)

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

	率①	准差②		④		
过去一个月	-0.87%	0.77%	-1.91%	0.76%	1.04%	0.01%
过去三个月	5.56%	0.92%	3.33%	0.93%	2.23%	-0.01%
过去六个月	3.13%	1.25%	0.30%	1.25%	2.83%	0.00%
过去一年	35.48%	1.27%	24.22%	1.27%	11.26%	0.00%
过去三年	71.81%	1.29%	46.50%	1.30%	25.31%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	162.53%	1.43%	99.70%	1.41%	62.83%	0.02%

鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.88%	0.77%	-1.91%	0.76%	1.03%	0.01%
过去三个月	5.52%	0.92%	3.33%	0.93%	2.19%	-0.01%
过去六个月	3.02%	1.25%	0.30%	1.25%	2.72%	0.00%
过去一年	35.27%	1.27%	24.22%	1.27%	11.05%	0.00%
自基金合同生效起 至今	91.00%	1.27%	60.53%	1.27%	30.47%	0.00%

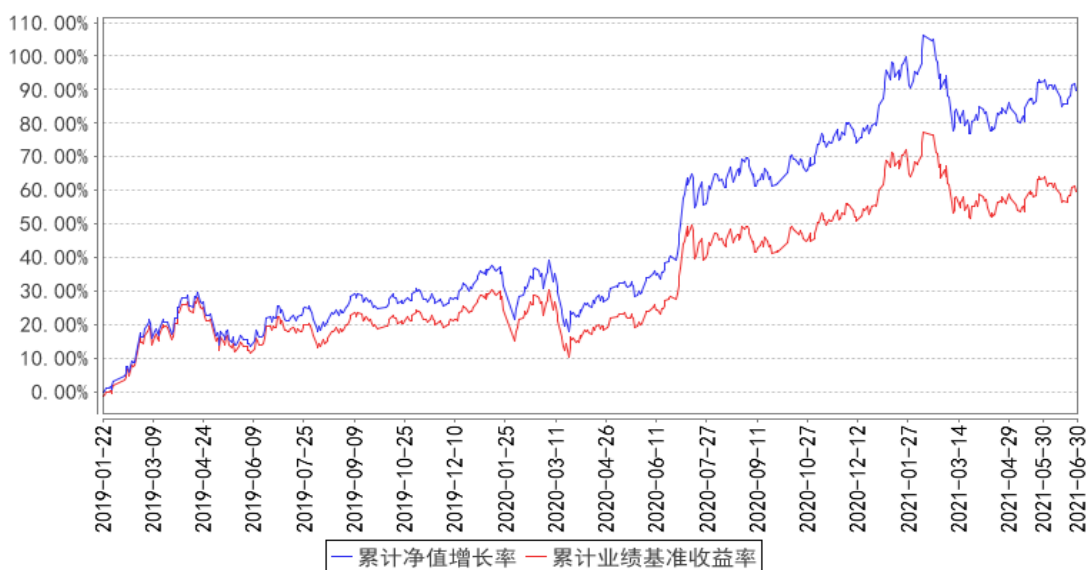
注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%

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

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



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



注：1、本基金基金合同于 2009 年 04 月 03 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日, 业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末, 公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.)、深圳市北融信投资发展有限公司组成, 公司性质为中外合资企业, 公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末, 公司管理资产总规模达到 9,012.31 亿元, 管理 237 只公募基金、13 只全国社保投资组合、4 只基本养老保险投资组合。经过 20 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的经验。

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		
张羽翔	基金经理	2016-09-24	-	14 年	张羽翔先生, 国籍中国, 工学硕士, 14 年证券从业经验。曾任招商银行软件中心 (原深圳市融博技术公司) 数据分析师; 2011 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任监察稽核部资深金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员, 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基金经理。2015 年 09 月至 2020 年 06 月担任鹏华上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2015 年 09 月至 2020 年 06 月担任上证民营企业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2016 年 06 月至 2018 年 05 月担任鹏华新丝路指数分级证券投资基金基金经理, 2016 年 07 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理, 2016 年 09 月至今担任鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2016 年 09 月至今担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2016 年 11 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理, 2016 年 11 月至 2020 年 07 月担任鹏华中证新能源指数分级证券投资基金基金经理, 2018 年 04 月至 2020 年 12 月担任鹏华

				<p>中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理, 2018 年 04 月至 2020 年 12 月担任鹏华创业板指数分级证券投资基金基金经理, 2018 年 05 月至 2018 年 08 月担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理, 2018 年 05 月至今担任鹏华港股通中证香港中小企业投资主题指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2018 年 05 月至 2020 年 12 月担任鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金经理, 2019 年 04 月至今担任鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2019 年 07 月至今担任鹏华中证国防交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2019 年 11 月至今担任鹏华港股通中证香港银行投资指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2019 年 12 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, 2020 年 02 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, 2020 年 03 月至今担任鹏华中证传媒交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华中证高铁产业指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华中证银行指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华中证酒指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华中证传媒指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华中证移动互联网指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至今担任鹏华创业板指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华中证一带一路主题指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 张羽翔先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。</p>
--	--	--	--	---

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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% 的交易次数为 2 次，主要原因在于指数基金成分股交易不活跃导致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期 A 类份额净值增长率为 3.13%，同期业绩比较基准增长率为 0.30%，C 类份额净值增长率为 3.02%，同期业绩比较基准增长率为 0.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年下半年的经济大体维持平稳，流动性环境保持合理宽松。在全球经济缓慢修复的背景下，股债整体维持震荡的概率较大，疫情走势依旧时最大的不确定性因素，建议紧密跟踪疫情变化，上半年政策组合是“货币稳+财政紧+监管严+地产压”，下半年可能“货币预调+财政温和+监管严厉”，投资领域新旧动能转换比较明显，投资机会的呈现结构性分化，投资者需关注政策友好及盈利持续改善的行业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF) 期末可供分配利润为 297,154,414.45 元，期末基金份额净值 2.505 元；鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF) 期末可供分配利润为 29,671,817.14 元，期末基金份额净值 1.910 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的

基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	35,789,893.01	34,479,562.39
结算备付金		365,536.26	69,543.23
存出保证金		54,489.66	84,087.39
交易性金融资产	6.4.7.2	558,825,592.90	528,000,652.53
其中：股票投资		558,825,592.90	528,000,652.53
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		-	1,003,215.59
应收利息	6.4.7.5	3,148.40	3,214.55
应收股利		-	-
应收申购款		2,098,637.84	1,269,390.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		597,137,298.07	564,909,665.76
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		1,444,311.34	-
应付赎回款		3,604,220.97	5,581,350.48
应付管理人报酬		351,599.58	341,381.73
应付托管费		70,319.89	68,276.37
应付销售服务费		15,119.17	14,859.18
应付交易费用	6.4.7.7	211,755.49	249,549.59
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	117,496.18	233,262.36
负债合计		5,814,822.62	6,488,679.71
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	248,067,724.35	241,288,987.57
未分配利润	6.4.7.10	343,254,751.10	317,131,998.48
所有者权益合计		591,322,475.45	558,420,986.05
负债和所有者权益总计		597,137,298.07	564,909,665.76

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额为 248,067,724.35 份，其中鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF) 基金份额总额为 197,411,056.62 份，基金份额净值 2.505 元；鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF) 基金份额总额为 50,656,667.73 份，基金份额净值 1.910 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		25,246,655.60	20,772,667.00
1. 利息收入		63,200.09	89,805.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	63,200.09	89,805.67
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		49,170,755.67	23,904,894.35
其中：股票投资收益	6.4.7.12	45,227,030.22	19,535,129.13

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	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,943,725.45	4,369,765.22
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.17	-24,149,564.41	-3,376,329.05
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	162,264.25	154,296.03
减：二、费用		3,099,991.31	2,692,044.60
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,958,261.77	1,611,875.69
2. 托管费	6.4.10.2.2	391,652.30	322,375.20
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	68,414.30	51,181.62
4. 交易费用	6.4.7.19	567,235.60	591,929.47
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	114,427.34	114,682.62
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）		22,146,664.29	18,080,622.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		22,146,664.29	18,080,622.40

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	241,288,987.57	317,131,998.48	558,420,986.05
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数（本期 利润）	-	22,146,664.29	22,146,664.29
三、本期基金份	6,778,736.78	3,976,088.33	10,754,825.11

额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	154,930,210.94	163,942,588.72	318,872,799.66
2. 基金赎回款	-148,151,474.16	-159,966,500.39	-308,117,974.55
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)	248,067,724.35	343,254,751.10	591,322,475.45
项目	上年度可比期间 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)	285,286,710.09	196,226,697.43	481,513,407.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	18,080,622.40	18,080,622.40
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)	-6,078,906.06	-8,313,283.26	-14,392,189.32
其中: 1. 基金申购款	201,722,923.19	84,614,146.02	286,337,069.21
2. 基金赎回款	-207,801,829.25	-92,927,429.28	-300,729,258.53
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)	279,207,804.03	205,994,036.57	485,201,840.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

邢彪

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2009]第 32 号文审核同意, 本基金 394,502,086.00 份基金份额于 2009 年 5 月 8 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。 根据鹏华基金管理有限公司《关于鹏华沪深 300 指数证券投资基金(LOF)和鹏华中证 500 指数证券投资基金(LOF)新增 C 类基金份额并修改基金合同的公告》, 本基金根据所收取费用的差异, 将基金份额分为不同的类别, 自 2019 年 1 月 22 日起增设 C 类基金份额, 原有的基金份额转为 A 类基金份额。其中, 在投资人申购基金时收取前端申购费用, 且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额, 称为 A 类基金份额; 从本类别基金资产中计提销售服务费, 且不收取申购费用的基金份额, 称为 C 类基金份额。C 类基金份额通过场外方式申购, 不在交易所上市交易, 亦不开通场内申购赎回方式。除经基金管理人另行公告, C 类基金份额持有人不能进行跨系统转登记。由于基金费用收取方式的不同, A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定, 本基金的标的指数为沪深 300 指数, 投资目标为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; 本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 主要投资于沪深 300 指数的成份股及其备选成份股 (含存托凭证) (投资比例不低于基金资产

净值的 90%)，现金或者到期日在一年以内的政府债券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。此外，为更好的实现投资目标，本基金将少量投资于非沪深 300 成份股（含存托凭证）、新股（含存托凭证）（首次发行或增发等）以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95% + 银行同业存款利率×5%。

本基金标的指数使用费由基金管理人鹏华基金管理有限公司承担，不计入本基金费用。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华沪深 300 指数证券投资基金（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 2021 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 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市

公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	35,789,893.01
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	35,789,893.01

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	469,516,187.46	558,825,592.90	89,309,405.44
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	469,516,187.46	558,825,592.90	89,309,405.44

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

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,978.30
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	148.05
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	-
其他	22.05
合计	3,148.40

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 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	211,755.49
银行间市场应付交易费用	-
合计	211,755.49

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,440.84
应付证券出借违约金	-
预提费用	114,055.34
合计	117,496.18

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	193,305,166.04	193,305,166.04
本期申购	47,134,615.08	47,134,615.08

本期赎回 (以“-”号填列)	-43,028,724.50	-43,028,724.50
-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	197,411,056.62	197,411,056.62

鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	47,983,821.53	47,983,821.53
本期申购	107,795,595.86	107,795,595.86
本期赎回 (以“-”号填列)	-105,122,749.66	-105,122,749.66
-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	50,656,667.73	50,656,667.73

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	272,336,536.38	3,836,684.72	276,173,221.10
本期利润	40,397,883.39	-24,232,286.18	16,165,597.21
本期基金份额 交易产生的变 动数	8,113,559.05	-3,297,962.91	4,815,596.14
其中：基金申 购款	72,626,207.35	-2,821,244.06	69,804,963.29
基金赎 回款	-64,512,648.30	-476,718.85	-64,989,367.15
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	320,847,978.82	-23,693,564.37	297,154,414.45

鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,276,258.19	20,682,519.19	40,958,777.38
本期利润	5,898,345.31	82,721.77	5,981,067.08
本期基金份额	3,497,213.64	-4,336,721.45	-839,507.81

交易产生的变动数			
其中：基金申购款	55,829,494.96	38,308,130.47	94,137,625.43
基金赎回款	-52,332,281.32	-42,644,851.92	-94,977,133.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,671,817.14	16,428,519.51	46,100,336.65

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	54,658.10
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,894.87
其他	6,647.12
合计	63,200.09

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

6.4.7.12 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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	45,227,030.22
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	45,227,030.22

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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	185,360,306.43
减：卖出股票成本总额	140,133,276.21
买卖股票差价收入	45,227,030.22

6.4.7.12.3 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

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,943,725.45
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	3,943,725.45

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-24,149,564.41
股票投资	-24,149,564.41
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	-24,149,564.41

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	135,698.95
基金转换费收入	26,565.30
合计	162,264.25

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	567,235.60
银行间市场交易费用	-
合计	567,235.60

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	372.00
上市年费	29,752.78
合计	114,427.34

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、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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 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 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
国信证券	152,722,260.95	41.02	22,684,047.91	6.10

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 2021年1月1日至2021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	141,695.83	43.51	104,969.30	49.57
关联方名称	上年度可比期间 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	20,700.86	6.63	7,664.21	4.85

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	1,958,261.77	1,611,875.69
其中: 支付销售机构的客户维护费	485,113.19	313,167.25

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	391,652.30	322,375.20

注: 支付基金托管人中国工商银行的托管费年费率为 0.15%, 逐日计提, 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)	鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)	合计

鹏华基金公司	-	19,005.46	19,005.46
合计	-	19,005.46	19,005.46
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)	鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)	合计
鹏华基金公司	-	26,939.91	26,939.91
合计	-	26,939.91	26,939.91

注：鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF) 基金份额不支付销售服务费；支付基金销售机构的鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF) 基金份额的销售服务费年费率为 0.20%，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×0.20%÷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

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固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	35,789,893.01	54,658.10	27,030,641.87	77,334.60

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
国信证券	688323	瑞华泰	网下申购	4,513	26,942.61
国信证券	300957	贝泰妮	网下申购	3,021	142,983.93
国信证券	300986	志特新材	网下申购	2,632	38,927.28
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
-	-	-	-	-	-

注：本基金在上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有 915,100.00 股基金托管人中国工商银行发行的 A 股普通股，成本总额为人民币 4,787,548.77 元，估值总额为人民币 4,731,067.00 元，占基金资产净值的比例为 0.80%；本基金持有 75,600.00 股国信证券发行的 A 股普通股，成本总额为人民币 912,280.03 元，估值总额为人民币 812,700.00 元，占基金资产净值的比例为 0.14%。（于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有 704,300.00 股基金托管人中国工商银行发行的 A 股普通股，成本总额为人民币 3,866,060.21 元，估值总额为人民币 3,507,414.00 元，占基金资产净值的比例为 0.72%；本基金持有 76,900.00 股国信证券发行的 A 股普通股，成本总额为人民币 858,383.88 元，估值总额为人民币 868,970.00 元，占基金资产净值的比例为 0.18%）

6.4.11 利润分配情况

注：无。

6.4.12 期末(2021 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
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	锁定期股票	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年07月02日	锁定期股票	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	锁定期股票	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年07月21日	锁定期股票	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	锁定期股票	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	锁定期股票	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	锁定期股票	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	锁定期股票	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	锁定期股票	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	锁定期股票	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	锁定期股票	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	锁定期股票	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	锁定期股票	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	锁定期股票	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	冠中生态于2021

		日	日							年 6 月 4 日实施权益分派方案, 每 10 股派人民币 0.8 元, 并转增 5 股。
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	锁定期 股票	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉 安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	锁定期 股票	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300957	贝泰 妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	锁定期 股票	47.33	251.96	303	14,340.99	76,343.88	-
300958	建工 修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	锁定期 股票	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业 科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	锁定期 股票	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水 海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	锁定期 股票	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金 辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	锁定期 股票	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲 特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	锁定期 股票	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同 药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	锁定期 股票	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣 股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	锁定期 股票	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林 精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	锁定期 股票	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚 精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	锁定期 股票	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-

300972	万辰生物	2021年 4月8日	2021年 10月19日	锁定期 股票	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021年 4月8日	2021年 10月15日	锁定期 股票	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021年 4月14日	2021年 10月21日	锁定期 股票	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年 4月15日	2021年 10月26日	锁定期 股票	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年 4月15日	2021年 10月26日	锁定期 股票	33.22	87.50	592	19,666.24	51,800.00	-
300981	中红医疗	2021年 4月19日	2021年 10月27日	锁定期 股票	48.59	90.39	391	18,998.69	35,342.49	-
300982	苏文电能	2021年 4月19日	2021年 10月27日	锁定期 股票	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021年 4月21日	2021年 10月29日	锁定期 股票	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021年 4月21日	2021年 11月1日	锁定期 股票	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年 4月28日	2021年 11月11日	锁定期 股票	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300992	泰福泵业	2021年 5月17日	2021年 11月25日	锁定期 股票	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021年 5月17日	2021年 11月24日	锁定期 股票	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年 5月17日	2021年 11月26日	锁定期 股票	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年 5月26日	2021年 12月3日	锁定期 股票	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021年 5月26日	2021年 12月2日	锁定期 股票	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-

		日	日								
300998	宁波方正	2021年 5月25 日	2021年 12月2 日	锁定期 股票	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32		-
301002	崧盛股份	2021年 5月27 日	2021年 12月7 日	锁定期 股票	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62		-
301004	嘉益股份	2021年 6月18 日	2021年 12月 27日	锁定期 股票	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28		-
301007	德迈仕	2021年 6月4 日	2021年 12月 16日	锁定期 股票	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32		-
301009	可靠股份	2021年 6月8 日	2021年 12月 17日	锁定期 股票	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89		-
301010	晶雪节能	2021年 6月9 日	2021年 12月 20日	锁定期 股票	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98		-
301011	华立科技	2021年 6月9 日	2021年 12月 17日	锁定期 股票	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00		-
301012	扬电科技	2021年 6月15 日	2021年 12月 22日	锁定期 股票	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20		-
301015	百洋医药	2021年 6月22 日	2021年 12月 30日	锁定期 股票	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46		-
301016	雷尔伟	2021年 6月23 日	2021年 12月 30日	锁定期 股票	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50		-
301018	申菱环境	2021年 6月28 日	2021年 7月7 日	新股未 上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41		-
301018	申菱环境	2021年 6月28 日	2022年 1月7 日	锁定期 股票	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78		-
301020	密封科技	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96		-
301020	密封科技	2021年 6月28 日	2022年 1月6 日	锁定期 股票	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44		-
301021	英诺	2021年	2021年	新股未	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14		-

	激光	6月28日	7月6日	上市						
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	锁定期股票	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688059	华锐精密	2021年2月1日	2021年8月9日	锁定期股票	37.09	160.26	1,023	37,943.07	163,945.98	-
688067	爱威科技	2021年6月7日	2021年12月16日	锁定期股票	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688276	百克生物	2021年6月17日	2021年12月27日	锁定期股票	36.35	79.48	3,486	126,716.10	277,067.28	-
688316	青云科技-U	2021年3月5日	2021年9月16日	锁定期股票	63.70	65.00	1,428	90,963.60	92,820.00	-
688359	三孚新科	2021年5月14日	2021年11月22日	锁定期股票	11.03	26.35	2,213	24,409.39	58,312.55	-
688517	金冠电气	2021年6月10日	2021年12月20日	锁定期股票	7.71	11.88	2,892	22,297.32	34,356.96	-
688609	九联科技	2021年3月15日	2021年9月23日	锁定期股票	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88	-
688665	四方光电	2021年2月2日	2021年8月9日	锁定期股票	29.53	129.46	1,687	49,817.11	218,399.02	-

688677	海泰新光	2021年 2月18 日	2021年 8月26 日	锁定期 股票	35.76	103.23	1,768	63,223.68	182,510.64	-
688689	银河微电	2021年 1月15 日	2021年 7月27 日	锁定期 股票	14.01	35.62	3,258	45,644.58	116,049.96	-

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

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

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

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021年 6月16 日	重大事项	5.59	2021 年7月 6日	6.15	91,977	872,469.53	514,151.43	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，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 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2020 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 2021 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%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	35,789,893.01	-	-	-	35,789,893.01
结算备付金	365,536.26	-	-	-	365,536.26
存出保证金	54,489.66	-	-	-	54,489.66
交易性金融资产	-	-	-	558,825,592.90	558,825,592.90
应收利息	-	-	-	3,148.40	3,148.40
应收申购款	-	-	-	2,098,637.84	2,098,637.84
资产总计	36,209,918.93	-	-	560,927,379.14	597,137,298.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,604,220.97	3,604,220.97
应付管理人报酬	-	-	-	351,599.58	351,599.58
应付托管费	-	-	-	70,319.89	70,319.89
应付证券清算款	-	-	-	1,444,311.34	1,444,311.34
应付销售服务费	-	-	-	15,119.17	15,119.17
应付交易费用	-	-	-	211,755.49	211,755.49

其他负债	-	-	-	117,496.18	117,496.18
负债总计	-	-	-	5,814,822.62	5,814,822.62
利率敏感度缺口	36,209,918.93	-	-	-555,112,556.52	591,322,475.45
上年度末 2020 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	34,479,562.39	-	-	-	34,479,562.39
结算备付金	69,543.23	-	-	-	69,543.23
存出保证金	84,087.39	-	-	-	84,087.39
交易性金融资产	-	-	-	-528,000,652.53	528,000,652.53
应收利息	-	-	-	3,214.55	3,214.55
应收申购款	-	-	-	1,269,390.08	1,269,390.08
应收证券清算款	-	-	-	1,003,215.59	1,003,215.59
资产总计	34,633,193.01	-	-	-530,276,472.75	564,909,665.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,581,350.48	5,581,350.48
应付管理人报酬	-	-	-	341,381.73	341,381.73
应付托管费	-	-	-	68,276.37	68,276.37
应付销售服务费	-	-	-	14,859.18	14,859.18
应付交易费用	-	-	-	249,549.59	249,549.59
其他负债	-	-	-	233,262.36	233,262.36
负债总计	-	-	-	6,488,679.71	6,488,679.71
利率敏感度缺口	34,633,193.01	-	-	-523,787,793.04	558,420,986.05

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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%。因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 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。

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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	558,825,592.90	94.50	528,000,652.53	94.55
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	558,825,592.90	94.50	528,000,652.53	94.55

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）	

分析	业绩比较基准上升 5%	28,181,695.09	26,542,785.08
	业绩比较基准下降 5%	-28,181,695.09	-26,542,785.08

注：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	558,825,592.90	93.58
	其中：股票	558,825,592.90	93.58
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	36,155,429.27	6.05
8	其他各项资产	2,156,275.90	0.36
9	合计	597,137,298.07	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,842,365.56	0.99
B	采矿业	11,785,393.77	1.99
C	制造业	307,447,759.38	51.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,852,942.09	1.67
E	建筑业	6,761,048.33	1.14
F	批发和零售业	3,979,144.39	0.67
G	交通运输、仓储和邮政业	16,051,524.31	2.71

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,278,031.40	3.09
J	金融业	131,677,340.79	22.27
K	房地产业	11,491,365.79	1.94
L	租赁和商务服务业	10,156,881.80	1.72
M	科学研究和技术服务业	7,941,019.82	1.34
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	1,004,809.00	0.17
Q	卫生和社会工作	11,794,298.00	1.99
R	文化、体育和娱乐业	2,333,003.00	0.39
S	综合	-	-
	合计	556,396,927.43	94.09

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,110,195.72	0.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	46,404.58	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	143,223.70	0.02
J	金融业	34,721.10	0.01
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	44,438.33	0.01
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	2,428,665.47	0.41

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	16,247	33,415,204.90	5.65
2	601318	中国平安	282,885	18,183,847.80	3.08
3	600036	招商银行	323,155	17,511,769.45	2.96
4	000858	五粮液	50,497	15,042,551.33	2.54
5	601012	隆基股份	112,988	10,037,853.92	1.70
6	000333	美的集团	128,736	9,187,888.32	1.55
7	600276	恒瑞医药	116,898	7,945,557.06	1.34
8	002415	海康威视	121,886	7,861,647.00	1.33
9	601166	兴业银行	379,652	7,801,848.60	1.32
10	601888	中国中免	25,434	7,632,743.40	1.29
11	603259	药明康德	46,698	7,312,439.82	1.24
12	300059	东方财富	215,869	7,078,344.51	1.20
13	000651	格力电器	125,506	6,538,862.60	1.11
14	600900	长江电力	296,930	6,128,635.20	1.04
15	002594	比亚迪	23,673	5,941,923.00	1.00
16	002475	立讯精密	127,609	5,870,014.00	0.99
17	600887	伊利股份	158,687	5,844,442.21	0.99
18	000001	平安银行	253,210	5,727,610.20	0.97
19	600030	中信证券	222,401	5,546,680.94	0.94
20	000725	京东方 A	884,505	5,519,311.20	0.93
21	300015	爱尔眼科	70,464	5,001,534.72	0.85
22	601398	工商银行	915,100	4,731,067.00	0.80
23	000568	泸州老窖	19,140	4,515,891.60	0.76
24	600031	三一重工	155,107	4,508,960.49	0.76
25	600309	万华化学	40,897	4,450,411.54	0.75
26	603501	韦尔股份	13,500	4,347,000.00	0.74
27	603288	海天味业	32,900	4,242,455.00	0.72
28	000002	万科 A	177,732	4,231,798.92	0.72
29	002714	牧原股份	68,558	4,169,697.56	0.71

30	600809	山西汾酒	9,000	4,032,000.00	0.68
31	300122	智飞生物	20,900	3,902,657.00	0.66
32	601919	中远海控	126,300	3,857,202.00	0.65
33	002142	宁波银行	94,131	3,668,285.07	0.62
34	601328	交通银行	717,400	3,515,260.00	0.59
35	600436	片仔癀	7,800	3,496,740.00	0.59
36	601899	紫金矿业	360,727	3,495,444.63	0.59
37	002304	洋河股份	15,550	3,221,960.00	0.54
38	002352	顺丰控股	47,500	3,215,750.00	0.54
39	002230	科大讯飞	46,378	3,134,225.24	0.53
40	002812	恩捷股份	13,200	3,090,120.00	0.52
41	300014	亿纬锂能	29,500	3,065,935.00	0.52
42	600000	浦发银行	306,500	3,065,000.00	0.52
43	300274	阳光电源	26,500	3,049,090.00	0.52
44	600438	通威股份	70,300	3,041,881.00	0.51
45	300124	汇川技术	40,407	3,000,623.82	0.51
46	600837	海通证券	251,913	2,896,999.50	0.49
47	000661	长春高新	7,300	2,825,100.00	0.48
48	000100	TCL 科技	366,633	2,804,742.45	0.47
49	601816	京沪高铁	512,600	2,711,654.00	0.46
50	000063	中兴通讯	80,500	2,675,015.00	0.45
51	002241	歌尔股份	62,336	2,664,240.64	0.45
52	300347	泰格医药	13,500	2,609,550.00	0.44
53	601601	中国太保	89,179	2,583,515.63	0.44
54	603986	兆易创新	13,684	2,571,223.60	0.43
55	600585	海螺水泥	62,531	2,566,897.55	0.43
56	600690	海尔智家	98,846	2,561,099.86	0.43
57	002271	东方雨虹	46,100	2,550,252.00	0.43
58	601668	中国建筑	547,947	2,547,953.55	0.43
59	002460	赣锋锂业	21,000	2,542,890.00	0.43
60	603799	华友钴业	22,170	2,531,814.00	0.43
61	002027	分众传媒	268,240	2,524,138.40	0.43
62	300142	沃森生物	40,900	2,523,530.00	0.43
63	600016	民生银行	555,334	2,449,022.94	0.41
64	600763	通策医疗	5,800	2,383,800.00	0.40
65	601288	农业银行	750,443	2,273,842.29	0.38
66	600196	复星医药	31,391	2,264,232.83	0.38
67	600048	保利地产	187,681	2,259,679.24	0.38
68	600703	三安光电	70,007	2,243,724.35	0.38
69	000338	潍柴动力	123,792	2,212,163.04	0.37
70	600919	江苏银行	308,200	2,188,220.00	0.37
71	002129	中环股份	55,300	2,134,580.00	0.36

72	601229	上海银行	259,558	2,128,375.60	0.36
73	601688	华泰证券	134,415	2,123,757.00	0.36
74	600050	中国联通	486,002	2,099,528.64	0.36
75	600660	福耀玻璃	36,425	2,034,336.25	0.34
76	600570	恒生电子	21,814	2,034,155.50	0.34
77	601211	国泰君安	117,700	2,017,378.00	0.34
78	600104	上汽集团	91,507	2,010,408.79	0.34
79	601766	中国中车	317,576	1,930,862.08	0.33
80	688111	金山办公	4,800	1,895,040.00	0.32
81	601169	北京银行	386,317	1,881,363.79	0.32
82	600999	招商证券	96,774	1,840,641.48	0.31
83	600019	宝钢股份	232,755	1,778,248.20	0.30
84	002371	北方华创	6,400	1,775,232.00	0.30
85	002311	海大集团	21,700	1,770,720.00	0.30
86	601988	中国银行	551,308	1,698,028.64	0.29
87	002049	紫光国微	11,000	1,696,090.00	0.29
88	002410	广联达	24,700	1,684,540.00	0.28
89	600406	国电南瑞	72,284	1,679,880.16	0.28
90	601088	中国神华	85,992	1,678,563.84	0.28
91	300498	温氏股份	116,400	1,672,668.00	0.28
92	601818	光大银行	432,524	1,634,940.72	0.28
93	300450	先导智能	26,400	1,587,696.00	0.27
94	300601	康泰生物	10,600	1,579,400.00	0.27
95	600745	闻泰科技	16,100	1,560,090.00	0.26
96	000625	长安汽车	59,265	1,557,484.20	0.26
97	000538	云南白药	13,251	1,533,405.72	0.26
98	600028	中国石化	348,995	1,521,618.20	0.26
99	600893	航发动力	27,800	1,478,682.00	0.25
100	601628	中国人寿	43,449	1,472,486.61	0.25
101	600346	恒力石化	54,960	1,442,150.40	0.24
102	601658	邮储银行	284,000	1,425,680.00	0.24
103	600588	用友网络	42,745	1,421,698.70	0.24
104	002821	凯莱英	3,800	1,415,880.00	0.24
105	601390	中国中铁	265,647	1,391,990.28	0.24
106	601633	长城汽车	31,727	1,382,979.93	0.23
107	601009	南京银行	130,911	1,377,183.72	0.23
108	002493	荣盛石化	79,250	1,368,647.50	0.23
109	300595	欧普康视	13,200	1,366,860.00	0.23
110	601377	兴业证券	139,710	1,349,598.60	0.23
111	601857	中国石油	253,273	1,339,814.17	0.23
112	688036	传音控股	6,191	1,297,014.50	0.22
113	300413	芒果超媒	18,600	1,275,960.00	0.22

114	600009	上海机场	25,947	1,248,829.11	0.21
115	600132	重庆啤酒	6,300	1,247,085.00	0.21
116	601225	陕西煤业	104,349	1,236,535.65	0.21
117	600584	长电科技	32,400	1,220,832.00	0.21
118	300408	三环集团	28,400	1,204,728.00	0.20
119	002601	龙佰集团	34,800	1,203,384.00	0.20
120	600426	华鲁恒升	38,600	1,194,670.00	0.20
121	600111	北方稀土	56,903	1,177,892.10	0.20
122	000776	广发证券	77,140	1,167,899.60	0.20
123	601939	建设银行	175,153	1,164,767.45	0.20
124	601100	恒立液压	13,536	1,163,013.12	0.20
125	002001	新和成	40,360	1,157,524.80	0.20
126	603882	金城医学	7,200	1,150,344.00	0.19
127	688012	中微公司	6,925	1,148,996.00	0.19
128	000895	双汇发展	36,068	1,146,962.40	0.19
129	300433	蓝思科技	38,899	1,144,019.59	0.19
130	600926	杭州银行	77,360	1,141,060.00	0.19
131	002050	三花智控	46,817	1,122,671.66	0.19
132	002179	中航光电	14,180	1,120,503.60	0.19
133	000166	申万宏源	235,200	1,100,736.00	0.19
134	600958	东方证券	108,900	1,087,911.00	0.18
135	600741	华域汽车	41,112	1,080,012.24	0.18
136	002841	视源股份	8,600	1,068,894.00	0.18
137	300003	乐普医疗	32,800	1,053,536.00	0.18
138	000963	华东医药	22,893	1,053,306.93	0.18
139	600600	青岛啤酒	9,100	1,052,415.00	0.18
140	002007	华兰生物	28,473	1,044,389.64	0.18
141	000786	北新建材	26,400	1,036,200.00	0.18
142	000157	中联重科	111,038	1,025,991.12	0.17
143	601006	大秦铁路	155,031	1,020,103.98	0.17
144	002607	中公教育	48,100	1,004,809.00	0.17
145	601901	方正证券	107,338	1,004,683.68	0.17
146	601336	新华保险	21,800	1,000,838.00	0.17
147	603806	福斯特	9,500	998,735.00	0.17
148	600015	华夏银行	160,997	996,571.43	0.17
149	002236	大华股份	46,925	990,117.50	0.17
150	601155	新城控股	23,600	981,760.00	0.17
151	601989	中国重工	238,000	980,560.00	0.17
152	600143	金发科技	46,900	978,334.00	0.17
153	600176	中国巨石	62,594	970,832.94	0.16
154	601138	工业富联	77,900	966,739.00	0.16
155	603993	洛阳钼业	184,700	953,052.00	0.16

156	000768	中航西飞	35,959	945,002.52	0.16
157	600352	浙江龙盛	68,034	934,787.16	0.16
158	601877	正泰电器	27,900	931,302.00	0.16
159	600010	包钢股份	594,314	921,186.70	0.16
160	600760	中航沈飞	15,260	920,178.00	0.16
161	601788	光大证券	51,000	912,390.00	0.15
162	600547	山东黄金	47,224	907,645.28	0.15
163	001979	招商蛇口	82,845	907,152.75	0.15
164	601600	中国铝业	171,017	906,390.10	0.15
165	300529	健帆生物	10,400	898,144.00	0.15
166	002008	大族激光	22,186	896,092.54	0.15
167	601186	中国铁建	120,393	894,519.99	0.15
168	688169	石头科技	700	882,700.00	0.15
169	603369	今世缘	16,200	877,392.00	0.15
170	002202	金风科技	72,056	876,200.96	0.15
171	601916	浙商银行	218,500	867,445.00	0.15
172	000876	新希望	58,700	861,129.00	0.15
173	002555	三七互娱	34,700	833,494.00	0.14
174	003816	中国广核	307,300	820,491.00	0.14
175	000938	紫光股份	37,459	819,602.92	0.14
176	002736	国信证券	75,600	812,700.00	0.14
177	601799	星宇股份	3,600	812,592.00	0.14
178	603899	晨光文具	9,600	811,776.00	0.14
179	600109	国金证券	63,000	799,470.00	0.14
180	601066	中信建投	25,300	795,179.00	0.13
181	000069	华侨城 A	106,799	794,584.56	0.13
182	600989	宝丰能源	57,400	785,232.00	0.13
183	000425	徐工机械	122,740	781,853.80	0.13
184	300136	信维通信	25,300	781,264.00	0.13
185	600150	中国船舶	46,800	772,668.00	0.13
186	601669	中国电建	199,553	772,270.11	0.13
187	603160	汇顶科技	5,900	764,817.00	0.13
188	600795	国电电力	308,643	750,002.49	0.13
189	000977	浪潮信息	26,500	745,445.00	0.13
190	002384	东山精密	35,500	739,820.00	0.13
191	000783	长江证券	100,965	739,063.80	0.12
192	603659	璞泰来	5,400	737,640.00	0.12
193	601238	广汽集团	56,700	734,265.00	0.12
194	600085	同仁堂	17,819	727,906.15	0.12
195	603019	中科曙光	26,320	726,695.20	0.12
196	688008	澜起科技	11,628	725,354.64	0.12
197	002624	完美世界	30,150	720,886.50	0.12

198	000596	古井贡酒	3,000	718,500.00	0.12
199	600079	人福医药	25,400	718,058.00	0.12
200	601838	成都银行	56,600	715,424.00	0.12
201	600886	国投电力	72,840	699,992.40	0.12
202	300677	英科医疗	5,600	698,880.00	0.12
203	600183	生益科技	29,800	697,618.00	0.12
204	600029	南方航空	115,754	696,839.08	0.12
205	601985	中国核电	137,200	694,232.00	0.12
206	300558	贝达药业	6,400	692,736.00	0.12
207	300144	宋城演艺	41,020	689,136.00	0.12
208	000703	恒逸石化	57,590	688,200.50	0.12
209	601108	财通证券	65,600	688,144.00	0.12
210	601360	三六零	56,177	685,921.17	0.12
211	601555	东吴证券	81,280	677,875.20	0.11
212	002600	领益智造	73,300	673,627.00	0.11
213	002414	高德红外	24,400	672,952.00	0.11
214	000066	中国长城	45,700	667,220.00	0.11
215	603517	绝味食品	7,900	665,891.00	0.11
216	603833	欧派家居	4,640	658,694.40	0.11
217	002252	上海莱士	87,800	657,622.00	0.11
218	002044	美年健康	71,248	649,069.28	0.11
219	601077	渝农商行	161,200	643,188.00	0.11
220	002938	鹏鼎控股	17,900	642,252.00	0.11
221	600522	中天科技	63,700	637,000.00	0.11
222	000728	国元证券	79,800	636,006.00	0.11
223	601607	上海医药	29,995	633,794.35	0.11
224	300033	同花顺	5,600	631,568.00	0.11
225	300676	华大基因	5,300	628,580.00	0.11
226	002602	世纪华通	97,526	626,116.92	0.11
227	600332	白云山	18,235	617,254.75	0.10
228	688396	华润微	6,751	614,476.02	0.10
229	600161	天坛生物	17,800	609,650.00	0.10
230	600872	中炬高新	14,400	605,088.00	0.10
231	601111	中国国航	77,751	604,902.78	0.10
232	600362	江西铜业	26,977	603,745.26	0.10
233	600383	金地集团	58,859	602,716.16	0.10
234	601800	中国交建	92,230	597,650.40	0.10
235	600115	中国东航	116,983	594,273.64	0.10
236	300628	亿联网络	7,000	586,600.00	0.10
237	600845	宝信软件	11,510	585,859.00	0.10
238	002508	老板电器	12,300	571,950.00	0.10
239	600061	国投资本	67,024	569,033.76	0.10

240	601727	上海电气	133,358	565,437.92	0.10
241	000860	顺鑫农业	13,400	565,212.00	0.10
242	002916	深南电路	5,060	562,317.80	0.10
243	601618	中国中冶	186,800	556,664.00	0.09
244	601162	天风证券	113,420	551,221.20	0.09
245	000708	中信特钢	26,300	548,092.00	0.09
246	601021	春秋航空	9,500	540,550.00	0.09
247	600705	中航产融	139,404	539,493.48	0.09
248	601878	浙商证券	40,600	531,048.00	0.09
249	603939	益丰药房	9,300	521,637.00	0.09
250	600606	绿地控股	95,200	518,840.00	0.09
251	002024	苏宁易购	91,977	514,151.43	0.09
252	601990	南京证券	48,200	507,064.00	0.09
253	002456	欧菲光	56,570	502,341.60	0.08
254	688363	华熙生物	1,800	500,148.00	0.08
255	002157	正邦科技	41,300	493,535.00	0.08
256	600011	华能国际	115,100	485,722.00	0.08
257	000656	金科股份	83,700	484,623.00	0.08
258	002463	沪电股份	31,200	482,664.00	0.08
259	600521	华海药业	22,800	476,064.00	0.08
260	600655	豫园股份	40,600	470,554.00	0.08
261	601933	永辉超市	99,116	468,818.68	0.08
262	601696	中银证券	21,900	450,921.00	0.08
263	600118	中国卫星	15,384	450,135.84	0.08
264	600848	上海临港	24,920	446,068.00	0.08
265	601216	君正集团	87,626	446,016.34	0.08
266	603392	万泰生物	1,680	435,422.40	0.07
267	600489	中金黄金	50,400	434,448.00	0.07
268	600018	上港集团	90,983	433,988.91	0.07
269	601995	中金公司	6,800	418,200.00	0.07
270	002558	巨人网络	31,400	417,620.00	0.07
271	601998	中信银行	80,451	410,300.10	0.07
272	002120	韵达股份	30,217	408,836.01	0.07
273	603195	公牛集团	2,000	404,000.00	0.07
274	601872	招商轮船	84,040	388,264.80	0.07
275	601319	中国人保	64,900	384,857.00	0.07
276	002673	西部证券	46,600	384,450.00	0.07
277	688009	中国通号	67,173	382,214.37	0.06
278	688126	沪硅产业-U	12,760	372,336.80	0.06
279	002739	万达电影	23,300	367,907.00	0.06
280	603338	浙江鼎力	6,200	363,878.00	0.06
281	601881	中国银河	33,400	360,052.00	0.06

282	603658	安图生物	4,520	342,480.40	0.06
283	600233	圆通速递	33,000	330,330.00	0.06
284	603233	大参林	6,200	316,882.00	0.05
285	600482	中国动力	16,900	294,398.00	0.05
286	601231	环旭电子	17,200	289,132.00	0.05
287	600025	华能水电	47,300	273,867.00	0.05
288	002153	石基信息	11,607	272,880.57	0.05
289	002032	苏泊尔	4,200	267,918.00	0.05
290	600340	华夏幸福	50,409	264,143.16	0.04
291	000800	一汽解放	24,300	262,926.00	0.04
292	601236	红塔证券	19,200	260,352.00	0.04
293	002939	长城证券	22,200	247,086.00	0.04
294	002773	康弘药业	9,590	221,816.70	0.04
295	601808	中海油服	15,200	218,272.00	0.04
296	600918	中泰证券	19,800	214,236.00	0.04
297	601698	中国卫通	11,500	186,185.00	0.03
298	603087	甘李药业	1,600	170,528.00	0.03
299	600299	安迪苏	10,500	125,580.00	0.02
300	002945	华林证券	6,900	95,358.00	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	688276	百克生物	3,486	277,067.28	0.05
2	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.04
3	688677	海泰新光	1,768	182,510.64	0.03
4	688059	华锐精密	1,023	163,945.98	0.03
5	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.03
6	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.02
7	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.02
8	688316	青云科技-U	1,428	92,820.00	0.02
9	300957	贝泰妮	303	76,343.88	0.01
10	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
11	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.01
12	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
13	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
14	300979	华利集团	592	51,800.00	0.01
15	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
16	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
17	300981	中红医疗	391	35,342.49	0.01
18	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
19	688517	金冠电气	2,892	34,356.96	0.01

20	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.01
21	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
22	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
23	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
24	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
25	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
26	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
27	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
28	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
29	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
30	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
31	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
32	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
33	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
34	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
35	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
36	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
37	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
38	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
39	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
40	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
41	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
42	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
43	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
44	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
45	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
46	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
47	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
48	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
49	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
50	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
51	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
52	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
53	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
54	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
55	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
56	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
57	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
58	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
59	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
60	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
61	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
62	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00

63	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
64	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
65	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
66	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
67	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
68	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
69	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
70	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
71	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
72	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
73	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
74	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	600519	贵州茅台	11,579,996.99	2.07
2	601318	中国平安	6,125,237.00	1.10
3	600036	招商银行	5,150,884.00	0.92
4	000858	五粮液	3,992,271.00	0.71
5	000333	美的集团	2,969,445.00	0.53
6	002415	海康威视	2,630,441.75	0.47
7	300274	阳光电源	2,583,077.00	0.46
8	601816	京沪高铁	2,566,281.00	0.46
9	601166	兴业银行	2,525,630.00	0.45
10	601012	隆基股份	2,510,915.80	0.45
11	600276	恒瑞医药	2,395,353.00	0.43
12	600900	长江电力	2,206,175.00	0.40
13	000651	格力电器	2,100,231.00	0.38
14	000725	京东方 A	2,064,416.00	0.37
15	601888	中国中免	2,052,964.00	0.37
16	688111	金山办公	2,013,347.83	0.36
17	300059	东方财富	1,973,303.00	0.35
18	603259	药明康德	1,908,613.75	0.34
19	600887	伊利股份	1,832,026.00	0.33
20	000001	平安银行	1,711,202.00	0.31

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	601318	中国平安	7,088,193.37	1.27

2	600519	贵州茅台	6,429,264.00	1.15
3	600036	招商银行	5,505,195.00	0.99
4	000858	五粮液	4,814,251.47	0.86
5	000333	美的集团	3,642,001.00	0.65
6	600276	恒瑞医药	3,050,212.60	0.55
7	601166	兴业银行	2,769,207.87	0.50
8	601888	中国中免	2,440,496.00	0.44
9	000651	格力电器	2,377,166.00	0.43
10	600887	伊利股份	2,224,872.00	0.40
11	300059	东方财富	2,037,901.20	0.36
12	600030	中信证券	1,940,912.00	0.35
13	000001	平安银行	1,859,603.40	0.33
14	600031	三一重工	1,770,083.00	0.32
15	601012	隆基股份	1,705,038.00	0.31
16	000002	万科 A	1,582,441.00	0.28
17	002594	比亚迪	1,571,769.00	0.28
18	601398	工商银行	1,535,089.00	0.27
19	000568	泸州老窖	1,445,621.00	0.26
20	600309	万华化学	1,443,243.00	0.26

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	195,107,780.99
卖出股票收入（成交）总额	185,360,306.43

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

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资

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、处罚的情形

江苏恒瑞医药股份有限公司

2021年3月25日，财政部针对江苏恒瑞医药股份有限公司的以下行为：一是2018年以非本公司发生的机票等报销专家讲课费、点评费、主持费，涉及金额108.80万元；二是2018年以非本公司发生的机票及过路费、咨询费、广告费等发票列支公司员工福利奖励支出，涉及金额214.91万元；三是所属连云港综合二办2018年以非本单位发生的过桥过路费发票报销办事处销售人员补贴、赠送客户礼品、学术活动餐费等费用，涉及金额96.19万元，对江苏恒瑞医药股份有限公司处以5万元的罚款。

兴业银行

2020年7月17日，中国人民银行上海分行对兴业银行股份有限公司上海分行1.未执行金融统计制度，错报统计数据，2.未按规定报备人民币结算账户开户资料，3.国库经收业务未使用规定科目核算，4.未按照规定履行客户身份识别义务，5.发布引人误解的营销宣传信息的违法违规行为，给予警告，并罚款123.5万元。

2020年9月4日，中国人民银行福州中心支行对兴业银行股份有限公司1.为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；2.为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追

溯性及支付全流程中的一致性；3. 违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；4. 违反银行卡收单外包管理规定；5. 未按规定履行客户身份识别义务的违法违规行，给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款。

2020 年 9 月 4 日，中国人民银行福州中心支行对兴业银行股份有限公司福州分行允许外包服务机构以特约商户名义入网并接收其发送的银行卡交易信息的违法违规行为，给予警告，没收违法所得 34.38 元，处 50 万元罚款。

2020 年 8 月 31 日，中国银保监会福建监管局对兴业银行股份有限公司同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保的违法违规行为，没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元。

招商银行

2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会针对招商银行股份有限公司的以下违法违规行为一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产，二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品，三、理财产品之间风险隔离不到位，四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准，五、同业投资接受第三方金融机构信用担保，六、理财资金池化运作，七、利用理财产品准备金调节收益，八、高净值客户认定不审慎，九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛，十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准，十一、投资集合资金信托计划人数超限，十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品，十三、信贷资产非真实转让，十四、全权委托业务不规范，十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务，十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权，十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失，十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯，十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目，二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保，二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目，二十二、理财资金认购商业银行增发的股票，二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产，二十四、为定制公募基金提供投资顾问，二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持，

二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券，二十七、瞒报案件信息，对公司处以罚款 7170 万元。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	54,489.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,148.40
5	应收申购款	2,098,637.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,156,275.90

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	688276	百克生物	277,067.28	0.05	锁定期股票
2	688665	四方光电	218,399.02	0.04	锁定期股票
3	688677	海泰新光	182,510.64	0.03	锁定期股票
4	688059	华锐精密	163,945.98	0.03	锁定期股票
5	688609	九联科技	158,587.88	0.03	锁定期股票

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)	26,363	7,488.19	58,672,473.29	29.72	138,738,583.33	70.28
鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)	4,798	10,557.87	12,647,088.52	24.97	38,009,579.21	75.03
合计	31,161	7,960.84	71,319,561.81	28.75	176,748,162.54	71.25

8.2 期末上市基金前十名持有人

鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	宁波航发贸易有限公司	869,380.00	17.96
2	欧静虹	208,300.00	4.30
3	李宏英	198,013.00	4.09
4	尹石菽	145,515.00	3.01
5	朱洪宏	116,200.00	2.40
6	屈丹耘	110,008.00	2.27
7	洪恒敏	101,916.00	2.11
8	彭世华	100,000.00	2.07
8	袁忠东	100,000.00	2.07
10	韩瑛	92,004.00	1.90

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	鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)	32,116.54	0.0163
	鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)	46,248.22	0.0913

人员持有本基金			
	合计	78,364.76	0.0316

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华沪深 300 指数 A 类 (LOF)	鹏华沪深 300 指数 C 类 (LOF)
基金合同生效日 (2009 年 4 月 3 日) 基金份额总额	1,994,428,997.48	-
本报告期期初基金份额总额	193,305,166.04	47,983,821.53
本报告期基金总申购份额	47,134,615.08	107,795,595.86
减：本报告期基金总赎回份额	43,028,724.50	105,122,749.66
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	197,411,056.62	50,656,667.73

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司原副总经理高阳先生辞去公司副总经理职务，经公司董事会审议通过，于 2021 年 1 月 16 日离任。

报告期内，经公司董事会审议通过，聘任王宗合先生担任公司副总经理，任职日期自 2021 年 1

月 28 日起；聘任梁浩先生担任公司副总经理，任职日期自 2021 年 1 月 28 日起。

本公司已将上述变更事项报相关监管部门备案。

报告期内，经公司股东会审议通过，史际春先生不再担任公司独立董事，于 2021 年 4 月 22 日离任；聘任蒋毅刚先生担任公司独立董事，任职日期自 2021 年 4 月 22 日起。

基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动：

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

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	152,722,260.95	41.02%	141,695.83	43.51%	-
东吴证券	1	51,859,977.47	13.93%	42,074.09	12.92%	-
国盛证券	1	51,009,179.99	13.70%	41,382.95	12.71%	-
中泰证券	1	36,552,356.99	9.82%	33,310.25	10.23%	-
华西证券	1	36,059,161.06	9.69%	29,254.85	8.98%	-

国元证券	1	22,134,118.11	5.95%	17,957.05	5.51%	-
中金公司	1	21,498,002.89	5.77%	19,591.08	6.02%	-
招商证券	1	458,391.00	0.12%	417.75	0.13%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	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

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

				比例		的比例
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东莞农村商业银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 01 月 04 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国银行股份有限公司定期定额申购和网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 01 月 04 日
3	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 01 月 16 日
4	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2020 年第 4 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 01 月 22 日
5	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 01 月 28 日
6	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 01 月 28 日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙商银行股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 02 月 02 日

8	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 02 月 06 日
9	鹏华基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 02 月 08 日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 06 日
11	鹏华基金管理有限公司关于对旗下基金中基金资产管理计划通过直销渠道申购、赎回、转换旗下公募基金免除相关费用的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 09 日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 10 日
13	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购贝泰妮首次公开发行 A 股的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 19 日
14	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 26 日
15	鹏华基金管理有限公司关于修改旗下 44 只证券投资基金基金合同部分条款的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 26 日
16	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2020 年年度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 30 日
17	鹏华基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 30 日
18	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 更新的招募说明书 (2021 年第 1 号)	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 31 日
19	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (C 类基金份额) (LOF) 基金产品资料概要 (更新)	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 31 日
20	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (A 类基金份额) (LOF) 基金产品资料概要 (更新)	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 03 月 31 日
21	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 10 日
22	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分	《上海证券报》、基金管	2021 年 04 月 13 日

	基金参与中泰证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
23	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 更新的招募说明书	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 14 日
24	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (A 类基金份额) (LOF) 基金产品资料概要 (更新)	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 14 日
25	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (C 类基金份额) (LOF) 基金产品资料概要 (更新)	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 14 日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与宁波银行股份有限公司申购（不含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 14 日
27	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与天风证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 16 日
28	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低申购（含定期定额投资）金额、单笔最低转换份额和账户最低余额限制的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 19 日
29	鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2021 年第 1 季度报告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 21 日
30	鹏华基金管理有限公司旗下部分基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 21 日
31	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购瑞华泰首次公开发行 A 股的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 23 日
32	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购志特新材首次公开发行 A 股的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 23 日
33	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 26 日
34	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司相关费率优惠活动的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 14 日
35	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2021 年 06 月 04 日

		基金电子披露网站	
--	--	----------	--

注：无。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- (二)《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- (三)《鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2021 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

2021 年 8 月 30 日