

# 鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金

## 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>7</b>  |
| 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         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 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              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 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                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>43</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 43        |
| 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       | 45        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 48        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 49        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 .....    | 50        |
| 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 ..... | 50        |
| 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 ..... | 50        |
| 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 .....    | 50        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 50        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 50        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 50        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>51</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 51        |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 .....                      | 52        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 52        |
| 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 .....      | 52        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>52</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>53</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 53        |
| 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 .....      | 53        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 53        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 53        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 53        |
| 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 .....         | 53        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 53        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 57        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>59</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....    | 59        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 59        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>59</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 59        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 59        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 59        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                     |
|--------------|---------------------|
| 基金名称         | 鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称         | 酒 ETF               |
| 场内简称         | 酒 ETF               |
| 基金主代码        | 512690              |
| 基金运作方式       | 交易型开放式              |
| 基金合同生效日      | 2019 年 4 月 4 日      |
| 基金管理人        | 鹏华基金管理有限公司          |
| 基金托管人        | 中国建设银行股份有限公司        |
| 报告期末基金份额总额   | 3,208,550,174.00 份  |
| 基金合同存续期      | 不定期                 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所             |
| 上市日期         | 2019 年 5 月 6 日      |

注：无。

### 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（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。（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</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。</p> <p>1) 定期调整 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。</p> <p>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。</p> <p>(3) 存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>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。</p> <p>3、衍生品投资策略 本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金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投资组合仓位调整的交易成本，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。本基金通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平，追求稳定的当期收益。</p> <p>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。</p> <p>5、融资及转融通投资策略 本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通业务。本基金将根据市场情况和组合风险收益，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资及转融通业务的法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证酒指数收益率  |
| 风险收益特征 | <p>本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。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。</p>  |

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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露 姓名 | 张戈         | 李申           |

|        |      |                                |                       |
|--------|------|--------------------------------|-----------------------|
| 负责人    | 联系电话 | 0755-82825720                  | 021-60637102          |
|        | 电子邮箱 | zhangge@phfund.com.cn          | lishen.zh@ccb.com     |
| 客户服务电话 |      | 4006788999                     | 021-60637111          |
| 传真     |      | 0755-82021126                  | 021-60635778          |
| 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 | 北京市西城区金融大街 25 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 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码   |      | 518048                         | 100033                |
| 法定代表人  |      | 何如                             | 田国立                   |

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021年1月1日-2021年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益       | 303,897,980.31            |
| 本期利润          | 155,580,937.92            |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0912                    |
| 本期加权平均净值利润率   | 4.42%                     |
| 本期基金份额净值增长率   | 6.01%                     |
| 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      | 2,257,483,704.20          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.7036                    |
| 期末基金资产净值      | 4,564,768,967.94          |
| 期末基金份额净值      | 1.4227                    |
| 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   | 184.54%                   |

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

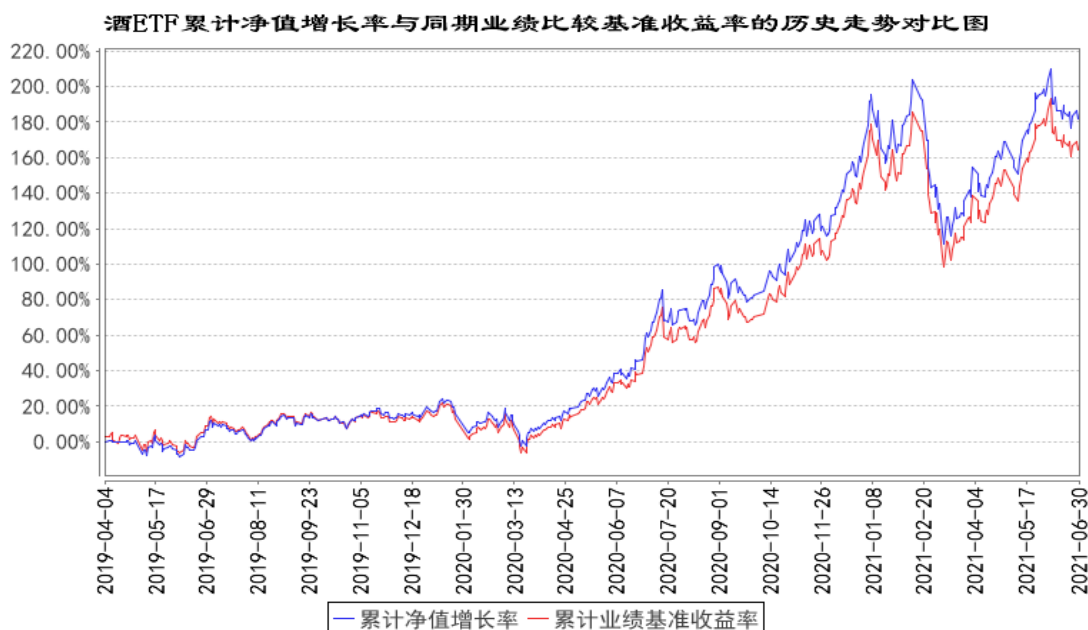
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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      | -3.95%   | 2.15%       | -4.32%     | 2.19%         | 0.37%  | -0.04% |
| 过去三个月      | 19.68%   | 1.99%       | 19.81%     | 2.03%         | -0.13% | -0.04% |
| 过去六个月      | 6.01%    | 2.52%       | 5.89%      | 2.56%         | 0.12%  | -0.04% |
| 过去一年       | 89.76%   | 2.32%       | 87.99%     | 2.36%         | 1.77%  | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 184.54%  | 2.03%       | 167.45%    | 2.10%         | 17.09% | -0.07% |

注：业绩比较基准=中证酒指数收益率



### 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



注：1、本基金基金合同于 2019 年 04 月 04 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 | 2019-04-04 | - | 14 年 | <p>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</p> |
|-----|------|------------|---|------|---|

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | <p>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,本报告期份额净值增长率为 6.01%,同期业绩比较基准增长率为 5.89%。

#### 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,本基金期末可供分配利润为 2,257,483,704.20 元,期末基金份额净值

1. 4227 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，中国建设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：鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金

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<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 112,873,537.52         | 55,134,938.32            |
| 结算备付金      |         | 12,885,731.18          | 11,504,286.22            |
| 存出保证金      |         | 2,135,598.00           | 670,584.03               |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 4,456,665,881.20       | 2,650,528,833.83         |

|                 |            |                           |                             |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 其中：股票投资         |            | 4,456,665,881.20          | 2,650,528,833.83            |
| 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         |            | 9,810,686.59              | 20,848,743.55               |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 39,880.29                 | 13,636.38                   |
| 应收股利            |            | 5,020.00                  | -                           |
| 应收申购款           |            | -                         | -                           |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                         | -                           |
| 资产总计            |            | 4,594,416,334.78          | 2,738,701,022.33            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2020年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                           |                             |
| 短期借款            |            | -                         | -                           |
| 交易性金融负债         |            | -                         | -                           |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                         | -                           |
| 应付证券清算款         |            | 80,207.92                 | -                           |
| 应付赎回款           |            | -                         | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 1,723,962.65              | 870,324.36                  |
| 应付托管费           |            | 344,792.53                | 174,064.86                  |
| 应付销售服务费         |            | -                         | -                           |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 5,359,285.84              | 4,333,718.89                |
| 应交税费            |            | 5,583.52                  | -                           |
| 应付利息            |            | -                         | -                           |
| 应付利润            |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                         | -                           |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 22,133,534.38             | 50,369,303.40               |
| 负债合计            |            | 29,647,366.84             | 55,747,411.51               |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 1,604,275,087.35          | 999,625,087.00              |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 2,960,493,880.59          | 1,683,328,523.82            |
| 所有者权益合计         |            | 4,564,768,967.94          | 2,682,953,610.82            |
| 负债和所有者权益总计      |            | 4,594,416,334.78          | 2,738,701,022.33            |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4227 元，基金份额总额 3,208,550,174.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金

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<br>6 月 30 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年<br>6 月 30 日 |
| 一、收入                   |            | 185,847,448.92                     | 78,251,701.32                      |
| 1. 利息收入                |            | 773,892.35                         | 59,910.38                          |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.11   | 302,223.25                         | 59,157.26                          |
| 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               |            | 471,669.10                         | 753.12                             |
| 其他利息收入                 |            | -                                  | -                                  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 300,140,079.79                     | 39,392,352.17                      |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12   | 287,371,039.18                     | 36,139,145.24                      |
| 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   | 12,769,040.61                      | 3,253,206.93                       |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -148,317,042.39                    | 37,375,739.87                      |
| 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   | 33,250,519.17                      | 1,423,698.90                       |
| 减：二、费用                 |            | 30,266,511.00                      | 3,055,697.51                       |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 8,681,050.00                       | 721,232.37                         |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 1,736,210.03                       | 144,246.50                         |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | -                                  | -                                  |
| 4. 交易费用                | 6.4.7.19   | 19,195,773.56                      | 2,024,575.84                       |
| 5. 利息支出                |            | -                                  | -                                  |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | -                                  | -                                  |
| 6. 税金及附加               |            | 1,698.08                           | 2.71                               |
| 7. 其他费用                | 6.4.7.20   | 651,779.33                         | 165,640.09                         |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |            | 155,580,937.92                     | 75,196,003.81                      |

|                   |  |                |               |
|-------------------|--|----------------|---------------|
| 减：所得税费用           |  | -              | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | 155,580,937.92 | 75,196,003.81 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金

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<br>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）                        | 999,625,087.00                             | 1,683,328,523.82  | 2,682,953,610.82   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 155,580,937.92    | 155,580,937.92     |
| 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）      | 604,650,000.35                             | 1,121,584,418.85  | 1,726,234,419.20   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 4,838,750,000.03                           | 8,084,509,027.20  | 12,923,259,027.23  |
| 2. 基金赎回款                               | -4,234,099,999.68                          | -6,962,924,608.35 | -11,197,024,608.03 |
| 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）                        | 1,604,275,087.35                           | 2,960,493,880.59  | 4,564,768,967.94   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 152,125,087.00                             | 29,086,761.08     | 181,211,848.08     |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期                  | -  | 75,196,003.81     | 75,196,003.81      |



|  |                  |                 |                   |
|--|------------------|-----------------|-------------------|
| 利润)                                    |                  |                 |                   |
| 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)      | 116,000,000.00   | 29,654,521.61   | 145,654,521.61    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,046,500,000.00 | 201,598,730.36  | 1,248,098,730.36  |
| 2. 基金赎回款                               | -930,500,000.00  | -171,944,208.75 | -1,102,444,208.75 |
| 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)                        | 268,125,087.00   | 133,937,286.50  | 402,062,373.50    |

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

鹏华中证酒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[2018]1984号《关于准予鹏华中证酒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《鹏华中证酒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356,125,087.00元(含募集股票市值),业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0232号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2019年4月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为356,125,087.00份基金份额,无认购资金利息份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2019]61号审核同意,本基金

356,125,087.00 份基金份额于 2019 年 5 月 6 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证酒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酒指数，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中证酒指数的成份股及其备选成份股（含存托凭证），该部分投资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。此外，为更好地实现投资目标，本基金将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上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具、同业存单、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为：中证酒指数收益率。

#### 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》、《鹏华中证酒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 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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 112,873,537.52         |
| 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             | 112,873,537.52         |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                  |                |
|---------------|------------------------|------------------|----------------|
|               | 成本                     | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            | 4,291,670,406.89       | 4,456,665,881.20 | 164,995,474.31 |
| 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            | 4,291,670,406.89       | 4,456,665,881.20 | 164,995,474.31 |

注：股票投资的公允价值和股票投资的公允价值变动均含可退替代款估值增值。

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

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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<br>2021年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 11,896.68         |
| 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  | 5,888.97          |
| 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   | 21,133.64         |
| 其他         | 961.00            |
| 合计         | 39,880.29         |

#### 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<br>2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 5,359,285.84      |
| 银行间市场应付交易费用 | -                 |
| 合计          | 5,359,285.84      |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021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    | 99,178.95     |
| 应付指数使用费 | 263,609.02    |
| 应退替代款   | 21,679,666.98 |
| 可退替代款   | 91,079.43     |
| 合计      | 22,133,534.38 |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目                        | 本期<br>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                      | 999,625,087.00             | 999,625,087.00    |
| 本期申购                      | 3,521,500,000.00           | 3,521,500,000.00  |
| 本期赎回（以“-”号填列）             | -3,303,500,000.00          | -3,303,500,000.00 |
| 2021年05月14日基金拆分/<br>份额折算前 | 1,217,625,087.00           | 1,217,625,087.00  |
| 基金拆分/份额折算调整               | 1,217,625,087.00           | -                 |
| 本期申购                      | 2,634,500,000.00           | 1,317,250,000.03  |
| 本期赎回（以“-”号填列）             | -1,861,200,000.00          | -930,599,999.68   |
| 本期末                       | 3,208,550,174.00           | 1,604,275,087.35  |

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. 根据《鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书》和《关于鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金份额拆分结果及恢复交易和申购、赎回的公告》的有关规定，本基金的基金管理人鹏华基金确定2021年5月14日为本基金的基金份额拆分日，拆分前基金份额总额为1,217,625,087.00份，拆分前基金份额净值为2.6959元。根据基金份额拆分公式，基金份额拆分比例为1:2，拆分后基金份额总额为2,435,250,174.00份，拆分后基金份额净值为1.3480元。本基金的基金管理人鹏华基金已根据上述拆分比例，对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了拆分，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于2021年5月14日进行了变更登记。

#### 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               | 1,158,650,755.39  | 524,677,768.43    | 1,683,328,523.82  |
| 本期利润               | 303,897,980.31    | -148,317,042.39   | 155,580,937.92    |
| 本期基金份额交易<br>产生的变动数 | 794,934,968.50    | 326,649,450.35    | 1,121,584,418.85  |
| 其中：基金申购款           | 6,200,739,556.22  | 1,883,769,470.98  | 8,084,509,027.20  |
| 基金赎回款              | -5,405,804,587.72 | -1,557,120,020.63 | -6,962,924,608.35 |
| 本期已分配利润            | -                 | -                 | -                 |

|     |                  |                |                  |
|-----|------------------|----------------|------------------|
| 本期末 | 2,257,483,704.20 | 703,010,176.39 | 2,960,493,880.59 |
|-----|------------------|----------------|------------------|

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 138,920.34                 |
| 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 | 149,382.94                 |
| 其他        | 13,919.97                  |
| 合计        | 302,223.25                 |

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<br>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 | 108,655,310.16             |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | 178,715,729.02             |
| 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               | 287,371,039.18             |

##### 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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 6,068,696,906.83           |
| 减：卖出股票成本总额 | 5,960,041,596.67           |
| 买卖股票差价收入   | 108,655,310.16             |

##### 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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 赎回基金份额对价总额  | 11,197,024,608.03          |
| 减：现金支付赎回款总额 | 6,031,115,422.03           |
| 减：赎回股票成本总额  | 4,987,193,456.98           |

|        |                |
|--------|----------------|
| 赎回差价收入 | 178,715,729.02 |
|--------|----------------|

#### 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

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   | 12,769,040.61        |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | 161,200.50           |
| 基金投资产生的股利收益   | -                    |
| 合计            | 12,769,040.61        |

## 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             | -148,317,042.39      |
| 股票投资                   | -148,317,042.39      |
| 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                     | -148,317,042.39      |

## 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 | -                    |
| 替代损益    | 33,250,519.17        |
| 合计      | 33,250,519.17        |

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                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 19,195,773.56        |
| 银行间市场交易费用 | -                    |
| 合计        | 19,195,773.56        |

## 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    | 39,671.58            |
| 信息披露费   | 59,507.37            |
| 证券出借违约金 | -                    |
| 银行汇划费用  | 31,737.33            |
| 指数使用费   | 520,863.05           |
| 合计      | 651,779.33           |

## 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             |
| 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) | 基金托管人             |
| 国信证券股份有限公司(“国信证券”)     | 基金管理人的股东、基金的一级交易商 |

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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                         | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |                         |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) |
| 国信证券  | 12,621,905,177.81          | 96.37                   | 1,236,119,170.70                | 90.23                   |

##### 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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |                    |              |                      |
|-------|----------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                   | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 国信证券  | 11,502,366.84              | 96.37              | 5,026,772.78 | 93.80                |

| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |                    |              |                      |
|-------|---------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 国信证券  | 1,126,478.66                    | 90.23              | 537,993.51   | 89.49                |

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<br>2021年1月1日至2021年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年<br>6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 8,681,050.00                   | 721,232.37                          |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 110,908.69                     | 8,625.74                            |

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0.50%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.50%÷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<br>2021年1月1日至2021年6<br>月30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年<br>6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,736,210.03                   | 144,246.50                          |

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费年费率为0.10%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

## 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

## 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

| 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日      |               |           |                |          |
|---------------------------------|---------------|-----------|----------------|----------|
| 关联方名称                           | 交易金额          | 利息收入      | 期末证券出借<br>业务余额 | 期末应收利息余额 |
| 国信证券                            | 68,404,446.00 | 42,782.89 | 10,140,500.00  | 3,666.64 |
| 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |               |           |                |          |
| 关联方名称                           | 交易金额          | 利息收入      | 期末证券出借<br>业务余额 | 期末应收利息余额 |
| 国信证券                            | -             | -         | -              | -        |

## 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                   | 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 |
|       |                      |                      |

|        | 期末余额           | 当期利息收入     | 期末余额          | 当期利息收入    |
|--------|----------------|------------|---------------|-----------|
| 中国建设银行 | 112,873,537.52 | 138,920.34 | 17,548,295.38 | 45,051.06 |

#### 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<br>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                       | 300957 | 贝泰妮  | 网下申购 | 8,523     | 403,393.59 |
| 国信证券                       | 300986 | 志特新材 | 网下申购 | 2,632     | 38,927.28  |
| 国信证券                       | 688323 | 瑞华泰  | 网下申购 | 4,513     | 26,942.61  |

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

无。

#### 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7月2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   | 2021年       | 2021年       | 锁定期    | 4.31  | 13.11  | 672      | 2,896.32  | 8,809.92  | -  |

|        |      |            |            |       |       |        |     |           |            |  |  |
|--------|------|------------|------------|-------|-------|--------|-----|-----------|------------|--|--|
|        | 电梯   | 1月13日      | 7月21日      | 股票    |       |        |     |           |            |  |  |
| 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 | 853 | 40,372.49 | 214,921.88 |  | -  |
| 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   |  | -  |

|        |      |                    |                     |           |       |        |       |           |           |   |
|--------|------|--------------------|---------------------|-----------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
|        |      | 日                  | 日                   |           |       |        |       |           |           |   |
| 300960 | 通业科技 | 2021年<br>3月22<br>日 | 2021年<br>9月29<br>日  | 锁定期<br>股票 | 12.08 | 23.06  | 234   | 2,826.72  | 5,396.04  | - |
| 300961 | 深水海纳 | 2021年<br>3月23<br>日 | 2021年<br>9月30<br>日  | 锁定期<br>股票 | 8.48  | 22.07  | 394   | 3,341.12  | 8,695.58  | - |
| 300962 | 中金辐照 | 2021年<br>3月29<br>日 | 2021年<br>10月<br>11日 | 锁定期<br>股票 | 3.40  | 16.37  | 576   | 1,958.40  | 9,429.12  | - |
| 300963 | 中洲特材 | 2021年<br>3月30<br>日 | 2021年<br>10月<br>11日 | 锁定期<br>股票 | 12.13 | 22.49  | 283   | 3,432.79  | 6,364.67  | - |
| 300966 | 共同药业 | 2021年<br>3月31<br>日 | 2021年<br>10月<br>11日 | 锁定期<br>股票 | 8.24  | 31.54  | 286   | 2,356.64  | 9,020.44  | - |
| 300967 | 晓鸣股份 | 2021年<br>4月2<br>日  | 2021年<br>10月<br>13日 | 锁定期<br>股票 | 4.54  | 11.54  | 507   | 2,301.78  | 5,850.78  | - |
| 300968 | 格林精密 | 2021年<br>4月6<br>日  | 2021年<br>10月<br>15日 | 锁定期<br>股票 | 6.87  | 12.07  | 1,162 | 7,982.94  | 14,025.34 | - |
| 300971 | 博亚精工 | 2021年<br>4月7<br>日  | 2021年<br>10月<br>15日 | 锁定期<br>股票 | 18.24 | 28.29  | 245   | 4,468.80  | 6,931.05  | - |
| 300972 | 万辰生物 | 2021年<br>4月8<br>日  | 2021年<br>10月<br>19日 | 锁定期<br>股票 | 7.19  | 12.65  | 430   | 3,091.70  | 5,439.50  | - |
| 300973 | 立高食品 | 2021年<br>4月8<br>日  | 2021年<br>10月<br>15日 | 锁定期<br>股票 | 28.28 | 115.71 | 360   | 10,180.80 | 41,655.60 | - |
| 300975 | 商络电子 | 2021年<br>4月14<br>日 | 2021年<br>10月<br>21日 | 锁定期<br>股票 | 5.48  | 13.03  | 492   | 2,696.16  | 6,410.76  | - |
| 300978 | 东箭科技 | 2021年<br>4月15<br>日 | 2021年<br>10月<br>26日 | 锁定期<br>股票 | 8.42  | 13.60  | 593   | 4,993.06  | 8,064.80  | - |
| 300979 | 华利集团 | 2021年<br>4月15<br>日 | 2021年<br>10月<br>26日 | 锁定期<br>股票 | 33.22 | 87.50  | 925   | 30,728.50 | 80,937.50 | - |
| 300981 | 中红医疗 | 2021年<br>4月19<br>日 | 2021年<br>10月<br>27日 | 锁定期<br>股票 | 48.59 | 90.39  | 601   | 29,202.59 | 54,324.39 | - |
| 300982 | 苏文   | 2021年              | 2021年               | 锁定期       | 15.83 | 45.29  | 317   | 5,018.11  | 14,356.93 | - |



|        |      |            |             |       |       |       |     |           |           |   |
|--------|------|------------|-------------|-------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
|        | 电能   | 4月19日      | 10月27日      | 股票    |       |       |     |           |           |   |
| 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 | - |
| 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<br>6月9日  | 2021年<br>12月<br>17日 | 锁定期<br>股票 | 14.20 | 33.84 | 175   | 2,485.00  | 5,922.00  | - |
| 301012 | 扬电科技 | 2021年<br>6月15日 | 2021年<br>12月<br>22日 | 锁定期<br>股票 | 8.05  | 24.26 | 170   | 1,368.50  | 4,124.20  | - |
| 301015 | 百洋医药 | 2021年<br>6月22日 | 2021年<br>12月<br>30日 | 锁定期<br>股票 | 7.64  | 38.83 | 462   | 3,529.68  | 17,939.46 | - |
| 301016 | 雷尔伟  | 2021年<br>6月23日 | 2021年<br>12月<br>30日 | 锁定期<br>股票 | 13.75 | 32.98 | 275   | 3,781.25  | 9,069.50  | - |
| 301018 | 申菱环境 | 2021年<br>6月28日 | 2021年<br>7月7日       | 新股未<br>上市 | 8.29  | 8.29  | 7,029 | 58,270.41 | 58,270.41 | - |
| 301018 | 申菱环境 | 2021年<br>6月28日 | 2022年<br>1月7日       | 锁定期<br>股票 | 8.29  | 8.29  | 782   | 6,482.78  | 6,482.78  | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021年<br>6月28日 | 2021年<br>7月6日       | 新股未<br>上市 | 10.64 | 10.64 | 3,789 | 40,314.96 | 40,314.96 | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021年<br>6月28日 | 2022年<br>1月6日       | 锁定期<br>股票 | 10.64 | 10.64 | 421   | 4,479.44  | 4,479.44  | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021年<br>6月28日 | 2021年<br>7月6日       | 新股未<br>上市 | 9.46  | 9.46  | 2,609 | 24,681.14 | 24,681.14 | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021年<br>6月28日 | 2022年<br>1月6日       | 锁定期<br>股票 | 9.46  | 9.46  | 290   | 2,743.40  | 2,743.40  | - |
| 605162 | 新中港  | 2021年<br>6月29日 | 2021年<br>7月7日       | 新股未<br>上市 | 6.07  | 6.07  | 1,377 | 8,358.39  | 8,358.39  | - |
| 605287 | 德才股份 | 2021年<br>6月28日 | 2021年<br>7月6日       | 新股未<br>上市 | 31.56 | 31.56 | 349   | 11,014.44 | 11,014.44 | - |
| 688087 | 英科再生 | 2021年<br>6月30日 | 2021年<br>7月9日       | 新股未<br>上市 | 21.96 | 21.96 | 2,469 | 54,219.24 | 54,219.24 | - |
| 688092 | 爱科科技 | 2021年<br>3月12日 | 2021年<br>9月22日      | 锁定期<br>股票 | 19.11 | 33.21 | 1,137 | 21,728.07 | 37,759.77 | - |
| 688195 | 腾景科技 | 2021年<br>3月18日 | 2021年<br>9月27日      | 锁定期<br>股票 | 13.60 | 19.87 | 2,693 | 36,624.80 | 53,509.91 | - |

|        |      |                    |                     |           |       |        |        |            |            |   |
|--------|------|--------------------|---------------------|-----------|-------|--------|--------|------------|------------|---|
|        |      | 日                  | 日                   |           |       |        |        |            |            |   |
| 688226 | 威腾电气 | 2021年<br>6月28<br>日 | 2021年<br>7月7<br>日   | 新股未<br>上市 | 6.42  | 6.42   | 2,693  | 17,289.06  | 17,289.06  | - |
| 688239 | 航宇科技 | 2021年<br>6月25<br>日 | 2021年<br>7月5<br>日   | 新股未<br>上市 | 11.48 | 11.48  | 4,926  | 56,550.48  | 56,550.48  | - |
| 688314 | 康拓医疗 | 2021年<br>5月11<br>日 | 2021年<br>11月<br>18日 | 锁定期<br>股票 | 17.34 | 74.48  | 1,085  | 18,813.90  | 80,810.80  | - |
| 688383 | 新益昌  | 2021年<br>4月21<br>日 | 2021年<br>10月<br>28日 | 锁定期<br>股票 | 19.58 | 106.24 | 2,701  | 52,885.58  | 286,954.24 | - |
| 688456 | 有研粉材 | 2021年<br>3月10<br>日 | 2021年<br>9月17<br>日  | 锁定期<br>股票 | 10.62 | 26.50  | 3,396  | 36,065.52  | 89,994.00  | - |
| 688630 | 芯碁微装 | 2021年<br>3月25<br>日 | 2021年<br>10月8<br>日  | 锁定期<br>股票 | 15.23 | 58.42  | 3,397  | 51,736.31  | 198,452.74 | - |
| 688633 | 星球石墨 | 2021年<br>3月17<br>日 | 2021年<br>9月24<br>日  | 锁定期<br>股票 | 33.62 | 53.14  | 1,558  | 52,379.96  | 82,792.12  | - |
| 688639 | 华恒生物 | 2021年<br>4月14<br>日 | 2021年<br>10月<br>22日 | 锁定期<br>股票 | 23.16 | 42.28  | 2,302  | 53,314.32  | 97,328.56  | - |
| 688656 | 浩欧博  | 2021年<br>1月6<br>日  | 2021年<br>7月13<br>日  | 锁定期<br>股票 | 35.26 | 72.60  | 1,371  | 48,341.46  | 99,534.60  | - |
| 688660 | 电气风电 | 2021年<br>5月11<br>日 | 2021年<br>11月<br>19日 | 锁定期<br>股票 | 5.44  | 7.26   | 51,238 | 278,734.72 | 371,987.88 | - |
| 688662 | 富信科技 | 2021年<br>3月25<br>日 | 2021年<br>10月8<br>日  | 锁定期<br>股票 | 15.61 | 29.51  | 2,556  | 39,899.16  | 75,427.56  | - |
| 688663 | 新风光  | 2021年<br>4月6<br>日  | 2021年<br>10月<br>13日 | 锁定期<br>股票 | 14.48 | 19.21  | 3,279  | 47,479.92  | 62,989.59  | - |
| 688680 | 海优新材 | 2021年<br>1月15<br>日 | 2021年<br>7月22<br>日  | 锁定期<br>股票 | 69.94 | 243.61 | 2,795  | 195,482.30 | 680,889.95 | - |

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，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的科创板股票，在受让后 6 个月内不得转让。

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

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

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称 | 出借到期日                          | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末估值总额        |
|----|--------|------|--------------------------------|--------|----------|---------------|
| 1  | 000568 | 泸州老窖 | 2021 年 7 月 14 日                | 235.94 | 114,000  | 26,897,160.00 |
| 2  | 000596 | 古井贡酒 | 2021 年 7 月 7 日-2021 年 7 月 14 日 | 239.50 | 85,900   | 20,573,050.00 |
| 3  | 000729 | 燕京啤酒 | 2021 年 7 月 14 日                | 7.24   | 44,000   | 318,560.00    |

|    |        |      |                      |        |           |                |
|----|--------|------|----------------------|--------|-----------|----------------|
| 4  | 000799 | 酒鬼酒  | 2021年7月14日           | 255.60 | 10,600    | 2,709,360.00   |
| 5  | 000858 | 五粮液  | 2021年7月6日-2021年7月14日 | 297.89 | 126,600   | 37,712,874.00  |
| 6  | 000860 | 顺鑫农业 | 2021年7月9日-2021年7月14日 | 42.18  | 40,500    | 1,708,290.00   |
| 7  | 000869 | 张裕A  | 2021年7月5日-2021年7月14日 | 37.14  | 51,700    | 1,920,138.00   |
| 8  | 002304 | 洋河股份 | 2021年7月5日-2021年7月14日 | 207.20 | 22,000    | 4,558,400.00   |
| 9  | 002461 | 珠江啤酒 | 2021年7月9日-2021年7月14日 | 10.94  | 63,900    | 699,066.00     |
| 10 | 002568 | 百润股份 | 2021年7月14日           | 94.79  | 12,000    | 1,137,480.00   |
| 11 | 600059 | 古越龙山 | 2021年7月5日-2021年7月14日 | 12.96  | 400,500   | 5,190,480.00   |
| 12 | 600132 | 重庆啤酒 | 2021年7月14日           | 197.95 | 10,000    | 1,979,500.00   |
| 13 | 600197 | 伊力特  | 2021年7月5日-2021年7月14日 | 30.66  | 316,400   | 9,700,824.00   |
| 14 | 600199 | 金种子酒 | 2021年7月5日-2021年7月14日 | 16.33  | 504,200   | 8,233,586.00   |
| 15 | 600543 | 莫高股份 | 2021年7月14日           | 8.34   | 10,000    | 83,400.00      |
| 16 | 600559 | 老白干酒 | 2021年7月5日-2021年7月14日 | 26.30  | 608,400   | 16,000,920.00  |
| 17 | 600600 | 青岛啤酒 | 2021年7月14日           | 115.65 | 12,000    | 1,387,800.00   |
| 18 | 600616 | 金枫酒业 | 2021年7月14日           | 8.57   | 14,000    | 119,980.00     |
| 19 | 600779 | 水井坊  | 2021年7月5日-2021年7月14日 | 126.35 | 30,000    | 3,790,500.00   |
| 20 | 600809 | 山西汾酒 | 2021年7月14日           | 448.00 | 10,000    | 4,480,000.00   |
| 21 | 603198 | 迎驾贡酒 | 2021年7月5日-2021年7月14日 | 44.30  | 75,200    | 3,331,360.00   |
| 22 | 603369 | 今世缘  | 2021年7月14日           | 54.16  | 20,000    | 1,083,200.00   |
| 23 | 603589 | 口子窖  | 2021年7月14日           | 67.69  | 12,000    | 812,280.00     |
| 24 | 603919 | 金徽酒  | 2021年7月5日-2021年7月14日 | 41.12  | 166,700   | 6,854,704.00   |
| 合计 | -      | -    | -                    | -      | 2,760,600 | 161,282,912.00 |

## 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建设银行股份有限公司，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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券；以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最

近 1 年的分类结果为 A 类，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 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、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具



还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>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                | 112,873,537.52 | -    | -    | -                | 112,873,537.52   |
| 结算备付金               | 12,885,731.18  | -    | -    | -                | 12,885,731.18    |
| 存出保证金               | 2,135,598.00   | -    | -    | -                | 2,135,598.00     |
| 交易性金融资产             | -              | -    | -    | 4,456,665,881.20 | 4,456,665,881.20 |
| 应收利息                | -              | -    | -    | 39,880.29        | 39,880.29        |
| 应收股利                | -              | -    | -    | 5,020.00         | 5,020.00         |
| 应收证券清算款             | -              | -    | -    | 9,810,686.59     | 9,810,686.59     |
| 资产总计                | 127,894,866.70 | -    | -    | 4,466,521,468.08 | 4,594,416,334.78 |
| 负债                  |                |      |      |                  |                  |
| 应付管理人报酬             | -              | -    | -    | 1,723,962.65     | 1,723,962.65     |
| 应付托管费               | -              | -    | -    | 344,792.53       | 344,792.53       |
| 应付证券清算款             | -              | -    | -    | 80,207.92        | 80,207.92        |
| 应付交易费用              | -              | -    | -    | 5,359,285.84     | 5,359,285.84     |
| 应交税费                | -              | -    | -    | 5,583.52         | 5,583.52         |
| 其他负债                | -              | -    | -    | 22,133,534.38    | 22,133,534.38    |
| 负债总计                | -              | -    | -    | 29,647,366.84    | 29,647,366.84    |
| 利率敏感度缺口             | 127,894,866.70 | -    | -    | 4,436,874,101.24 | 4,564,768,967.94 |
| 上年度末<br>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                | 55,134,938.32  | -    | -    | -                | 55,134,938.32    |
| 结算备付金               | 11,504,286.22  | -    | -    | -                | 11,504,286.22    |
| 存出保证金               | 670,584.03     | -    | -    | -                | 670,584.03       |
| 交易性金融资产             | -              | -    | -    | 2,650,528,833.83 | 2,650,528,833.83 |
| 应收利息                | -              | -    | -    | 13,636.38        | 13,636.38        |
| 应收证券清算款             | -              | -    | -    | 20,848,743.55    | 20,848,743.55    |
| 资产总计                | 67,309,808.57  | -    | -    | 2,671,391,213.76 | 2,738,701,022.33 |
| 负债                  |                |      |      |                  |                  |
| 应付管理人报酬             | -              | -    | -    | 870,324.36       | 870,324.36       |
| 应付托管费               | -              | -    | -    | 174,064.86       | 174,064.86       |
| 应付交易费用              | -              | -    | -    | 4,333,718.89     | 4,333,718.89     |
| 其他负债                | -              | -    | -    | 50,369,303.40    | 50,369,303.40    |

|         |               |   |                   |                  |
|---------|---------------|---|-------------------|------------------|
| 负债总计    | -             | - | 55,747,411.51     | 55,747,411.51    |
| 利率敏感度缺口 | 67,309,808.57 | - | -2,615,643,802.25 | 2,682,953,610.82 |

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<br>2021年6月30日 | 上年度末<br>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  | 4,456,665,881.20 | 97.63         | 2,650,528,833.83 | 98.79         |
| 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            | 4,456,665,881.20 | 97.63         | 2,650,528,833.83 | 98.79         |

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%          | 224,036,661.27              | 129,751,443.18    |
|    | 业绩比较基准下降5%          | -224,036,661.27             | -129,751,443.18   |

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   | 4,456,665,881.20 | 97.00         |
|    | 其中：股票  | 4,456,665,881.20 | 97.00         |
| 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      | 125,759,268.70   | 2.74   |
| 8 | 其他各项资产            | 11,991,184.88    | 0.26   |
| 9 | 合计                | 4,594,416,334.78 | 100.00 |

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2.1 的合计项不含可退替代款估值增值。

2、报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 161,282,912.00 元，占基金资产净值比为 3.53%。

## 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         | -                | -            |
| B  | 采矿业              | -                | -            |
| C  | 制造业              | 4,430,125,657.42 | 97.05        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -                | -            |
| E  | 建筑业              | -                | -            |
| F  | 批发和零售业           | 23,037,367.43    | 0.50         |
| 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  | -                | -            |
| 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 | 4,453,163,024.85 | 97.56 |

### 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              | 3,274,833.60 | 0.07         |
| 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    | 0.00         |
| 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  | 50,403.70    | 0.00         |
| J  | 金融业              | 34,721.10    | 0.00         |
| 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    | 0.00         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -            | -            |
| P  | 教育               | -            | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -            | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -            | -            |
| S  | 综合               | -            | -            |
|    | 合计               | 3,500,483.35 | 0.08         |

### 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  | 000858 | 五粮液  | 2,347,019 | 699,153,489.91 | 15.32        |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 317,247   | 652,481,904.90 | 14.29        |
| 3  | 000568 | 泸州老窖 | 2,062,501 | 486,626,485.94 | 10.66        |

|    |        |      |           |                |      |
|----|--------|------|-----------|----------------|------|
| 4  | 600809 | 山西汾酒 | 962,339   | 431,127,872.00 | 9.44 |
| 5  | 002304 | 洋河股份 | 1,706,576 | 353,602,547.20 | 7.75 |
| 6  | 000799 | 酒鬼酒  | 1,041,132 | 266,113,339.20 | 5.83 |
| 7  | 600132 | 重庆啤酒 | 1,085,705 | 214,915,304.75 | 4.71 |
| 8  | 600600 | 青岛啤酒 | 1,600,376 | 185,083,484.40 | 4.05 |
| 9  | 002568 | 百润股份 | 1,693,791 | 160,554,448.89 | 3.52 |
| 10 | 603369 | 今世缘  | 2,809,477 | 152,161,274.32 | 3.33 |
| 11 | 000596 | 古井贡酒 | 526,048   | 125,988,496.00 | 2.76 |
| 12 | 600779 | 水井坊  | 871,101   | 110,063,611.35 | 2.41 |
| 13 | 603589 | 口子窖  | 1,550,752 | 104,970,402.88 | 2.30 |
| 14 | 000860 | 顺鑫农业 | 2,334,755 | 98,479,965.90  | 2.16 |
| 15 | 600559 | 老白干酒 | 2,813,682 | 73,999,836.60  | 1.62 |
| 16 | 603198 | 迎驾贡酒 | 1,080,973 | 47,887,103.90  | 1.05 |
| 17 | 000729 | 燕京啤酒 | 6,345,120 | 45,938,668.80  | 1.01 |
| 18 | 600197 | 伊力特  | 1,244,800 | 38,165,568.00  | 0.84 |
| 19 | 600199 | 金种子酒 | 2,050,102 | 33,478,165.66  | 0.73 |
| 20 | 600059 | 古越龙山 | 2,459,817 | 31,879,228.32  | 0.70 |
| 21 | 603919 | 金徽酒  | 666,259   | 27,396,570.08  | 0.60 |
| 22 | 300755 | 华致酒行 | 564,503   | 23,037,367.43  | 0.50 |
| 23 | 000869 | 张裕 A | 608,492   | 22,599,392.88  | 0.50 |
| 24 | 002461 | 珠江啤酒 | 1,995,886 | 21,834,992.84  | 0.48 |
| 25 | 600616 | 金枫酒业 | 2,079,310 | 17,819,686.70  | 0.39 |
| 26 | 601579 | 会稽山  | 1,112,900 | 13,332,542.00  | 0.29 |
| 27 | 600543 | 莫高股份 | 1,021,500 | 8,519,310.00   | 0.19 |
| 28 | 600573 | 惠泉啤酒 | 557,300   | 5,951,964.00   | 0.13 |

### 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  | 688680 | 海优新材 | 2,795  | 680,889.95 | 0.01         |
| 2  | 688660 | 电气风电 | 51,238 | 371,987.88 | 0.01         |
| 3  | 688383 | 新益昌  | 2,701  | 286,954.24 | 0.01         |
| 4  | 300957 | 贝泰妮  | 853    | 214,921.88 | 0.00         |
| 5  | 688630 | 芯碁微装 | 3,397  | 198,452.74 | 0.00         |
| 6  | 688656 | 浩欧博  | 1,371  | 99,534.60  | 0.00         |
| 7  | 300919 | 中伟股份 | 610    | 99,430.00  | 0.00         |
| 8  | 688639 | 华恒生物 | 2,302  | 97,328.56  | 0.00         |
| 9  | 688456 | 有研粉材 | 3,396  | 89,994.00  | 0.00         |
| 10 | 688633 | 星球石墨 | 1,558  | 82,792.12  | 0.00         |
| 11 | 300979 | 华利集团 | 925    | 80,937.50  | 0.00         |
| 12 | 688314 | 康拓医疗 | 1,085  | 80,810.80  | 0.00         |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 13 | 688662 | 富信科技 | 2,556 | 75,427.56 | 0.00 |
| 14 | 301018 | 申菱环境 | 7,811 | 64,753.19 | 0.00 |
| 15 | 688663 | 新风光  | 3,279 | 62,989.59 | 0.00 |
| 16 | 688239 | 航宇科技 | 4,926 | 56,550.48 | 0.00 |
| 17 | 300981 | 中红医疗 | 601   | 54,324.39 | 0.00 |
| 18 | 688087 | 英科再生 | 2,469 | 54,219.24 | 0.00 |
| 19 | 688195 | 腾景科技 | 2,693 | 53,509.91 | 0.00 |
| 20 | 301020 | 密封科技 | 4,210 | 44,794.40 | 0.00 |
| 21 | 300973 | 立高食品 | 360   | 41,655.60 | 0.00 |
| 22 | 688092 | 爱科科技 | 1,137 | 37,759.77 | 0.00 |
| 23 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230 | 34,721.10 | 0.00 |
| 24 | 301021 | 英诺激光 | 2,899 | 27,424.54 | 0.00 |
| 25 | 001207 | 联科科技 | 682   | 22,581.02 | 0.00 |
| 26 | 301009 | 可靠股份 | 801   | 22,339.89 | 0.00 |
| 27 | 300941 | 创识科技 | 399   | 19,926.06 | 0.00 |
| 28 | 301015 | 百洋医药 | 462   | 17,939.46 | 0.00 |
| 29 | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 30 | 300932 | 三友联众 | 492   | 15,601.32 | 0.00 |
| 31 | 300982 | 苏文电能 | 317   | 14,356.93 | 0.00 |
| 32 | 300968 | 格林精密 | 1,162 | 14,025.34 | 0.00 |
| 33 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 34 | 300940 | 南极光  | 307   | 13,317.66 | 0.00 |
| 35 | 300614 | 百川畅银 | 329   | 13,285.02 | 0.00 |
| 36 | 300937 | 药易购  | 244   | 13,105.24 | 0.00 |
| 37 | 300942 | 易瑞生物 | 443   | 12,634.36 | 0.00 |
| 38 | 603171 | 税友股份 | 637   | 12,230.40 | 0.00 |
| 39 | 300997 | 欢乐家  | 928   | 12,110.40 | 0.00 |
| 40 | 301002 | 崧盛股份 | 201   | 11,581.62 | 0.00 |
| 41 | 605287 | 德才股份 | 349   | 11,014.44 | 0.00 |
| 42 | 300996 | 普联软件 | 241   | 10,177.43 | 0.00 |
| 43 | 300962 | 中金辐照 | 576   | 9,429.12  | 0.00 |
| 44 | 300952 | 恒辉安防 | 340   | 9,207.20  | 0.00 |
| 45 | 301016 | 雷尔伟  | 275   | 9,069.50  | 0.00 |
| 46 | 300966 | 共同药业 | 286   | 9,020.44  | 0.00 |
| 47 | 300945 | 曼卡龙  | 474   | 8,949.12  | 0.00 |
| 48 | 300948 | 冠中生态 | 324   | 8,884.08  | 0.00 |
| 49 | 300931 | 通用电梯 | 672   | 8,809.92  | 0.00 |
| 50 | 300961 | 深水海纳 | 394   | 8,695.58  | 0.00 |
| 51 | 300950 | 德固特  | 219   | 8,569.47  | 0.00 |
| 52 | 605162 | 新中港  | 1,377 | 8,358.39  | 0.00 |
| 53 | 300958 | 建工修复 | 300   | 8,166.00  | 0.00 |
| 54 | 300986 | 志特新材 | 264   | 8,070.48  | 0.00 |
| 55 | 300987 | 川网传媒 | 301   | 8,069.81  | 0.00 |

|    |        |      |     |          |      |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 56 | 300978 | 东箭科技 | 593 | 8,064.80 | 0.00 |
| 57 | 300993 | 玉马遮阳 | 410 | 7,908.90 | 0.00 |
| 58 | 300930 | 屹通新材 | 322 | 7,882.56 | 0.00 |
| 59 | 300985 | 致远新能 | 295 | 7,318.95 | 0.00 |
| 60 | 300971 | 博亚精工 | 245 | 6,931.05 | 0.00 |
| 61 | 301004 | 嘉益股份 | 312 | 6,845.28 | 0.00 |
| 62 | 300927 | 江天化学 | 217 | 6,531.70 | 0.00 |
| 63 | 300975 | 商络电子 | 492 | 6,410.76 | 0.00 |
| 64 | 300963 | 中洲特材 | 283 | 6,364.67 | 0.00 |
| 65 | 301011 | 华立科技 | 175 | 5,922.00 | 0.00 |
| 66 | 300943 | 春晖智控 | 255 | 5,867.55 | 0.00 |
| 67 | 300967 | 晓鸣股份 | 507 | 5,850.78 | 0.00 |
| 68 | 300972 | 万辰生物 | 430 | 5,439.50 | 0.00 |
| 69 | 300929 | 华骐环保 | 183 | 5,407.65 | 0.00 |
| 70 | 300960 | 通业科技 | 234 | 5,396.04 | 0.00 |
| 71 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 72 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 73 | 301007 | 德迈仕  | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 74 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 75 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 76 | 300992 | 泰福泵业 | 200 | 4,064.00 | 0.00 |
| 77 | 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  | 000858 | 五粮液  | 1,851,296,994.87 | 69.00          |
| 2  | 000568 | 泸州老窖 | 1,668,600,883.60 | 62.19          |
| 3  | 002304 | 洋河股份 | 1,133,085,451.40 | 42.23          |
| 4  | 000799 | 酒鬼酒  | 596,855,855.25   | 22.25          |
| 5  | 000596 | 古井贡酒 | 443,218,669.34   | 16.52          |
| 6  | 002568 | 百润股份 | 434,829,734.92   | 16.21          |
| 7  | 000860 | 顺鑫农业 | 422,092,821.06   | 15.73          |
| 8  | 000729 | 燕京啤酒 | 149,339,150.49   | 5.57           |
| 9  | 000869 | 张裕 A | 70,542,448.33    | 2.63           |
| 10 | 300755 | 华致酒行 | 58,066,324.87    | 2.16           |
| 11 | 002461 | 珠江啤酒 | 57,038,966.15    | 2.13           |
| 12 | 600519 | 贵州茅台 | 43,566,627.00    | 1.62           |
| 13 | 600809 | 山西汾酒 | 19,926,200.00    | 0.74           |
| 14 | 600616 | 金枫酒业 | 16,432,185.11    | 0.61           |
| 15 | 600779 | 水井坊  | 12,036,498.36    | 0.45           |
| 16 | 601579 | 会稽山  | 11,968,260.00    | 0.45           |



|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 17 | 600543 | 莫高股份 | 7,266,423.00 | 0.27 |
| 18 | 603369 | 今世缘  | 6,439,670.00 | 0.24 |
| 19 | 600059 | 古越龙山 | 5,547,309.00 | 0.21 |
| 20 | 600573 | 惠泉啤酒 | 5,462,820.96 | 0.20 |

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  | 000568 | 泸州老窖   | 1,515,292,214.78 | 56.48           |
| 2  | 000858 | 五粮液    | 1,515,211,345.53 | 56.48           |
| 3  | 002304 | 洋河股份   | 1,002,929,050.75 | 37.38           |
| 4  | 000799 | 酒鬼酒    | 509,213,779.81   | 18.98           |
| 5  | 000596 | 古井贡酒   | 396,273,754.70   | 14.77           |
| 6  | 002568 | 百润股份   | 386,084,079.90   | 14.39           |
| 7  | 000860 | 顺鑫农业   | 371,886,401.79   | 13.86           |
| 8  | 000729 | 燕京啤酒   | 131,044,061.65   | 4.88            |
| 9  | 000869 | 张裕 A   | 61,058,547.91    | 2.28            |
| 10 | 300755 | 华致酒行   | 50,458,858.82    | 1.88            |
| 11 | 002461 | 珠江啤酒   | 45,343,090.64    | 1.69            |
| 12 | 600809 | 山西汾酒   | 33,133,056.00    | 1.23            |
| 13 | 600132 | 重庆啤酒   | 12,536,349.48    | 0.47            |
| 14 | 600600 | 青岛啤酒   | 3,320,360.00     | 0.12            |
| 15 | 603369 | 今世缘    | 3,278,882.00     | 0.12            |
| 16 | 603198 | 迎驾贡酒   | 1,930,961.00     | 0.07            |
| 17 | 603589 | 口子窖    | 1,849,217.93     | 0.07            |
| 18 | 688538 | 和辉光电-U | 1,680,963.14     | 0.06            |
| 19 | 300957 | 贝泰妮    | 1,372,930.00     | 0.05            |
| 20 | 688083 | 中望软件   | 811,954.00       | 0.03            |

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 | 7,038,138,184.45 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 6,068,696,906.83 |

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：无。

### 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，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金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投资组合仓位调整的交易成本，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、处罚的情形

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 2,135,598.00  |
| 2  | 应收证券清算款 | 9,810,686.59  |
| 3  | 应收股利    | 5,020.00      |
| 4  | 应收利息    | 39,880.29     |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 11,991,184.88 |

#### 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  | 688680 | 海优新材 | 680,889.95  | 0.01          | 锁定期股票    |
| 2  | 688660 | 电气风电 | 371,987.88  | 0.01          | 锁定期股票    |
| 3  | 688383 | 新益昌  | 286,954.24  | 0.01          | 锁定期股票    |
| 4  | 300957 | 贝泰妮  | 214,921.88  | 0.00          | 锁定期股票    |
| 5  | 688630 | 芯碁微装 | 198,452.74  | 0.00          | 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

#### 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<br>(户) | 户均持有的<br>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 (%) |
| 178,192      | 18,006.14     | 479,794,015.00 | 14.95      | 2,728,756,159.00 | 85.05      |

## 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  | 李凤锁                                     | 53,397,500.00 | 1.66        |
| 2  | 北京诚通金控投资有限公司                            | 50,894,374.00 | 1.59        |
| 3  | 崔绍伟                                     | 34,544,200.00 | 1.08        |
| 4  | 众安在线财产保险股份有限公司—自有资金                     | 32,890,000.00 | 1.03        |
| 5  | 国寿投资控股有限公司                              | 28,214,200.00 | 0.88        |
| 6  | 高华—汇丰—GOLDMAN, SACHS & CO. LLC          | 27,954,500.00 | 0.87        |
| 7  | 浦银安盛基金—上海银行—浦银安盛博悦2号 FOF 集合资产管理计划       | 27,817,700.00 | 0.87        |
| 8  | 中信证券信安盈利混合型养老金产品—中信银行股份有限公司             | 26,925,131.00 | 0.84        |
| 9  | 中信证券—北京银行心喜系列人民币京华远见七日淘金理财管理计划—中信证券北京银行 | 23,627,000.00 | 0.74        |
| 10 | 郑雅贤                                     | 13,766,283.00 | 0.43        |

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4月4日）基金份额总额 | 356,125,087.00   |
| 本报告期期初基金份额总额             | 999,625,087.00   |
| 本报告期基金总申购份额              | 6,156,000,000.00 |

|                          |                  |
|--------------------------|------------------|
| 减：本报告期基金总赎回份额            | 5,164,700,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 1,217,625,087.00 |
| 本报告期期末基金份额总额             | 3,208,550,174.00 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|-----|------|-----------|----|
|------|-----|------|-----------|----|

|            | 元数量 | 成交金额              | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 佣金            | 占当期佣<br>金<br>总量的比<br>例 |   |
|------------|-----|-------------------|----------------------|---------------|------------------------|---|
| 国信证券       | 2   | 12,621,905,177.81 | 96.37%               | 11,502,366.84 | 96.37%                 | - |
| 中金财富       | 2   | 238,143,822.69    | 1.82%                | 217,020.81    | 1.82%                  | - |
| 广发证券       | 1   | 78,268,831.33     | 0.60%                | 71,325.06     | 0.60%                  | - |
| 西部证券       | 1   | 71,123,902.87     | 0.54%                | 64,815.93     | 0.54%                  | - |
| 兴业证券       | 1   | 33,454,387.16     | 0.26%                | 30,486.87     | 0.26%                  | - |
| 银河证券       | 1   | 24,505,648.62     | 0.19%                | 22,331.70     | 0.19%                  | - |
| 方正证券       | 2   | 22,980,080.76     | 0.18%                | 20,941.86     | 0.18%                  | - |
| 平安证券       | 2   | 6,241,862.98      | 0.05%                | 5,688.24      | 0.05%                  | - |
| 中信证券       | 2   | 829,899.10        | 0.01%                | 726.05        | 0.01%                  | - |
| 安信证券       | 2   | -                 | -                    | -             | -                      | - |
| 长城证券       | 1   | -                 | -                    | -             | -                      | - |
| 长江证券       | 1   | -                 | -                    | -             | -                      | - |
| 德邦证券       | 1   | -                 | -                    | -             | -                      | - |
| 东方财富<br>证券 | 2   | -                 | -                    | -             | -                      | - |
| 东方证券       | 1   | -                 | -                    | -             | -                      | - |
| 东海证券       | 1   | -                 | -                    | -             | -                      | - |
| 东莞证券       | 2   | -                 | -                    | -             | -                      | - |
| 光大证券       | 1   | -                 | -                    | -             | -                      | - |
| 广州证券       | 1   | -                 | -                    | -             | -                      | - |
| 国金证券       | 1   | -                 | -                    | -             | -                      | - |
| 国泰君安       | 2   | -                 | -                    | -             | -                      | - |
| 海通证券       | 2   | -                 | -                    | -             | -                      | - |
| 华创证券       | 1   | -                 | -                    | -             | -                      | - |
| 华融证券       | 1   | -                 | -                    | -             | -                      | - |
| 华西证券       | 1   | -                 | -                    | -             | -                      | - |
| 瑞信方正       | 1   | -                 | -                    | -             | -                      | - |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 瑞银证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 新时代证<br>券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 中航证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：交易单元选择的标准和程序：

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

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

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2) 选择交易单元的程序：

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

用交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 债券交易 |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              |
|--------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
|        | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国信证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中金财富   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 广发证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 西部证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 兴业证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 银河证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 方正证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 平安证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中信证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 安信证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 长城证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 长江证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 德邦证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东方财富证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东方证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东海证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东莞证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 光大证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 广州证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国金证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国泰君安   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 海通证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华创证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华融证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华西证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 瑞信方正   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 瑞银证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 上海证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |



|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 申万宏源<br>证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券       | - | - | - | - | - | - |
| 湘财证券       | - | - | - | - | - | - |
| 新时代证<br>券  | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司       | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券       | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投<br>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    | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 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 | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 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                                      | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年01月16日 |
| 4  | 鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告                        | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 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                                      | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 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                                      | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年01月28日 |
| 7  | 鹏华基金管理有限公司澄清公告  | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年02月06日 |
| 8  | 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                  | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年02月08日 |
| 9  | 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                      | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年03月19日 |

|    |   |                               |             |
|----|---|-------------------------------|-------------|
| 10 | 鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金基金合同                       | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年03月26日 |
| 11 | 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          | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年03月26日 |
| 12 | 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                  | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年03月30日 |
| 13 | 鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金2020年年度报告                  | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年03月30日 |
| 14 | 鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书                   | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年03月31日 |
| 15 | 鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要(更新)               | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年03月31日 |
| 16 | 鹏华基金管理有限公司澄清公告                                | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年04月10日 |
| 17 | 鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金2021年1季度报告                 | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年04月21日 |
| 18 | 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              | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年04月21日 |
| 19 | 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            | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年04月23日 |
| 20 | 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           | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年04月23日 |
| 21 | 鹏华基金管理有限公司澄清公告                                | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年04月26日 |
| 22 | 关于鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分及相关业务安排的公告       | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年04月30日 |
| 23 | 关于鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分及相关业务安排的第一次提示性公告 | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年05月07日 |
| 24 | 关于鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分及相关              | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会         | 2021年05月11日 |

|    |   |                               |                  |
|----|---|-------------------------------|------------------|
|    | 业务安排的第二次提示性公告                             | 基金电子披露网站                      |                  |
| 25 | 关于鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金份额拆分结果及恢复交易和申购、赎回的公告 | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 05 月 17 日 |
| 26 | 鹏华基金管理有限公司澄清公告                            | 《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 06 月 04 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

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)《鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华中证酒交易型开放式指数证券投资基金 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