

# 鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF） 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	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	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产 (基金净值) 变动表	17
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64

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 .....	64
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 .....	64
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 .....	64
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 .....	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	65
7.12 投资组合报告附注 .....	65
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>66</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	66
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
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 .....	67
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>67</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>67</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
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 .....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
10.4 基金投资策略的改变 .....	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	68
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 .....	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	68
10.8 其他重大事件 .....	69
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>71</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 .....	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	71
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>71</b>
12.1 备查文件目录 .....	71
12.2 存放地点 .....	71
12.3 查阅方式 .....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）	
基金简称	鹏华中证 500 指数（LOF）	
场内简称	鹏华 500LOF	
基金主代码	160616	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2010 年 2 月 5 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	339,238,047.23 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的 证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2010 年 4 月 28 日	
下属分级基金的基 金简称	鹏华中证 500 指数 A 类（LOF）	鹏华中证 500 指数 C 类（LOF）
下属分级基金的场 内简称	鹏华 500LOF	-
下属分级基金的交 易代码	160616	006938
报告期末下属分级 基金的份额总额	316,927,256.99 份	22,310,790.24 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资方式，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以实现了对中证 500 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用被动式指数投资方法，原则上按照成份股在中证 500 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

#### 1、资产配置策略

为实现紧密跟踪业绩比较基准的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于中证 500 指数成份股和备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

#### 2、股票投资策略

##### (1) 股票投资组合的构建

本基金在建仓期内，将按照中证 500 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，对基金资产进行适当调整，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中证 500 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、新股增发因素等变化，对其进行适时调整，以保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。

##### 1) 定期调整

根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

##### 2) 不定期调整

根据指数编制规则，当中证 500 指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整；

根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

##### (3) 存托凭证投资策略

本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

#### 3、债券投资策略

本基金可以根据流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债

	券进行配置。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。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金, 其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金, 为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益品种。

注: 无。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	郭明
	联系电话	0755-81395402	(010)66105799
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	(010)66105798
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		何如	陈四清

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位: 人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)
本期已实现收益	-1,682,788.70	-162,762.62
本期利润	17,846,571.68	2,005,581.49

加权平均基金份额本期利润	0.0569	0.0802
本期加权平均净值利润率	3.32%	4.45%
本期基金份额净值增长率	3.38%	3.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	215,445,544.05	15,100,152.25
期末可供分配基金份额利润	0.6798	0.6768
期末基金资产净值	532,372,801.04	39,296,313.55
期末基金份额净值	1.680	1.761
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	68.00%	76.10%

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

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)

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

过去一个月	-0.18%	0.87%	-0.76%	0.89%	0.58%	-0.02%
过去三个月	-3.84%	0.77%	-5.10%	0.78%	1.26%	-0.01%
过去六个月	3.38%	0.73%	2.21%	0.75%	1.17%	-0.02%
过去一年	-4.22%	0.89%	-6.63%	0.91%	2.41%	-0.02%
过去三年	21.56%	1.13%	2.53%	1.13%	19.03%	0.00%
自基金合同生效起 至今	68.00%	1.54%	37.35%	1.51%	30.65%	0.03%

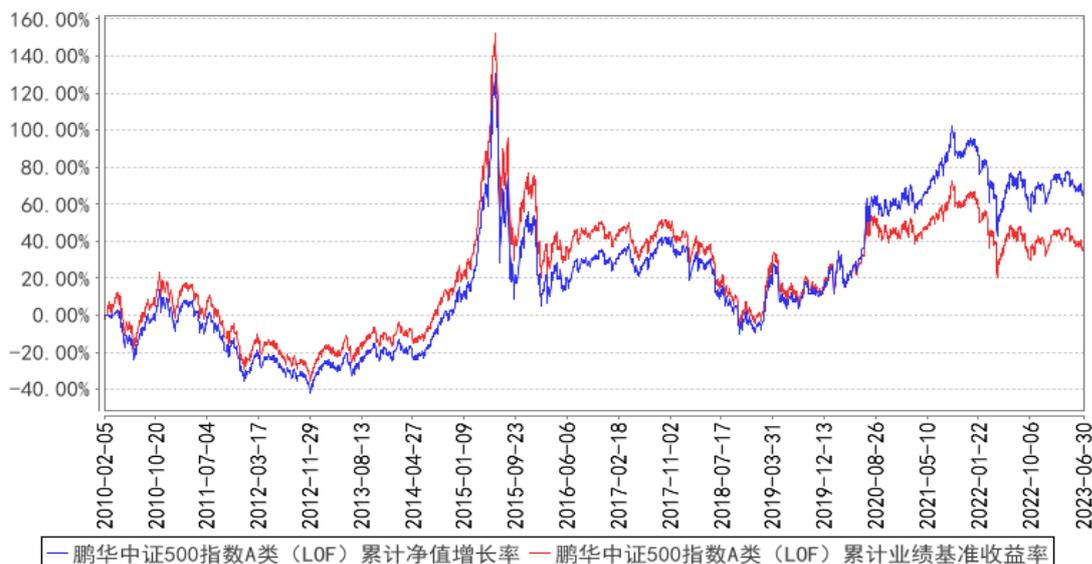
## 鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-0.23%	0.88%	-0.76%	0.89%	0.53%	-0.01%
过去三个月	-3.93%	0.77%	-5.10%	0.78%	1.17%	-0.01%
过去六个月	3.22%	0.73%	2.21%	0.75%	1.01%	-0.02%
过去一年	-4.45%	0.89%	-6.63%	0.91%	2.18%	-0.02%
过去三年	20.70%	1.13%	2.53%	1.13%	18.17%	0.00%
自基金合同生效起 至今	76.10%	1.26%	35.84%	1.27%	40.26%	-0.01%

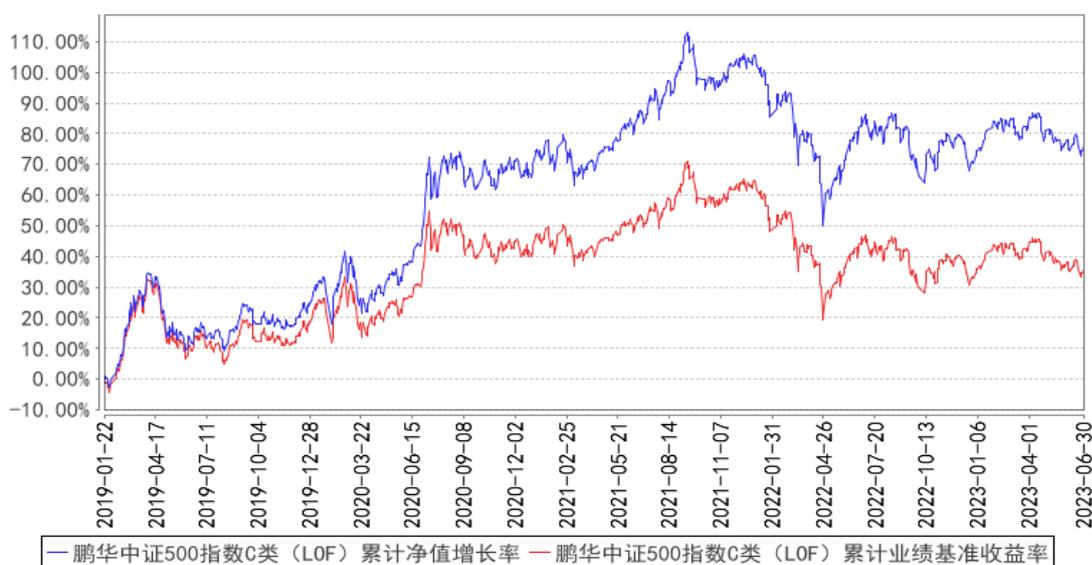
注：业绩比较基准=中证 500 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%

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

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



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



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

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日, 业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末, 公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司 (Eurizon Capital SGR S.p.A.)、深圳市北融信投资发展有限公司组成, 公司性质为中外合资企业, 公司注册资本 15,000 万元人民币。截至 6 月 30 日, 公司管理资产总规模达到 11517 亿元, 301 只公募基金、13 只全国社保投资组合、7 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金, 在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

#### 4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏俊杰	基金经理	2022-08-12	-	11 年	苏俊杰先生, 国籍中国, 理学硕士, 11 年证券从业经验。曾任 MSCI INC. 分析师, 华泰柏瑞基金管理有限公司专户投资经理, 财通基金管理有限公司基金经理。2019 年 07 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任量化及衍生品投资部副总经理, 现担任量化及衍生品投资部总经理/基金经理。2021 年 03 月至今担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理, 2021 年 03 月至今担任鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今担任鹏华中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理, 2022 年 08 月至今担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 08 月至今担任鹏华创业板指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 08 月至今担任鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 02 月至今担任鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金基金经理, 苏俊杰先生具备基金从业

					资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。
--	--	--	--	--	-----------------------

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

3. 余展昌 2023 年 8 月 24 日新任本基金基金经理，苏俊杰 2023 年 8 月 24 日离任本基金基金经理。

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

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华中证 500 指数 A (LOF) 份额净值增长率为 3.38%，同期业绩比较基准增长率为 2.21%，鹏华中证 500 指数 C (LOF) 份额净值增长率为 3.22%，同期业绩比较基准增长率为 2.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年,市场对于经济复苏的预期不断修正,指数宽幅震荡以结构性机会为主,A 股市场呈现出存量交易的特征,热点分化、轮动快,使得上半年市场整体的赚钱效应一般。

海外方面,美债收益率持续深度倒挂,利率维持高位,表面上看通胀回落速度较为温和,经济韧性较强,但我们认为利率维持高位的时间越久的同时也蕴含着更大的系统性金融风险,美联储本轮加息可能已经进入尾声。

展望下半年,尽管市场风险偏好仍然处于低位,但是边际上的积极因素也在不断增加,经济基本面温和复苏的态势仍将延续,权益市场估值低位,股债性价比处于历史高位,A 股赚钱效应有望回归;此外,美联储如果停止加息甚至开启宽松周期,将提升全球股市的风险偏好,外资也将重新回到净流入的状态,利好上半年调整幅度较大的核心资产。

#### 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,鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF) 期末可供分配利润为 215,445,544.05 元,期末基金份额净值 1.680 元;鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF) 期末可供分配利润为 15,100,152.25 元,期末基金份额净值 1.761 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定,本基金管理人将会综合考虑各方面因素,在严格

遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	41,110,310.96	37,826,255.80
结算备付金		-	207,623.85
存出保证金		20,092.69	41,244.44
交易性金融资产	6.4.7.2	529,821,228.82	526,495,521.19
其中：股票投资		529,821,228.82	526,495,521.19
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		1,188.19	213,101.02
应收股利		-	-
应收申购款		1,591,660.50	1,305,254.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		572,544,481.16	566,089,000.53
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.91	-
应付赎回款		161,226.40	503,396.82
应付管理人报酬		348,635.94	360,454.52
应付托管费		69,727.19	72,090.92
应付销售服务费		6,523.66	6,879.85
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	289,252.47	497,079.47
负债合计		875,366.57	1,439,901.58
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	339,238,047.23	346,013,663.39
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	232,431,067.36	218,635,435.56
净资产合计		571,669,114.59	564,649,098.95
负债和净资产总计		572,544,481.16	566,089,000.53

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额为 339,238,047.23 份，其中鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF) 基金份额总额为 316,927,256.99 份，基金份额净值 1.680 元；鹏华中证 500 指数

C 类 (LOF) 基金份额总额为 22,310,790.24 份, 基金份额净值 1.761 元。

## 6.2 利润表

会计主体: 鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		22,699,868.90	-57,178,144.88
1. 利息收入		73,574.17	98,022.17
其中: 存款利息收入	6.4.7.13	73,574.17	98,022.17
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)		894,971.51	-12,991,818.05
其中: 股票投资收益	6.4.7.14	-5,243,689.49	-19,068,109.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	6,138,661.00	6,076,291.81
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.20	21,697,704.49	-44,351,735.79
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.21	33,618.73	67,386.79
<b>减: 二、营业总支出</b>		2,847,715.73	2,578,733.15
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,169,187.21	1,939,075.89
2. 托管费	6.4.10.2.2	433,837.47	387,815.19
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	45,021.40	67,141.05

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	199,669.65	184,701.02
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		19,852,153.17	-59,756,878.03
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		19,852,153.17	-59,756,878.03
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		19,852,153.17	-59,756,878.03

### 6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体: 鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	346,013,663.39	-	218,635,435.56	564,649,098.95
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	346,013,663.39	-	218,635,435.56	564,649,098.95
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,775,616.16	-	13,795,631.80	7,020,015.64

(一)、综合收益总额	-	-	19,852,153.17	19,852,153.17
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-6,775,616.16	-	-6,056,521.37	-12,832,137.53
其中:1.基金申购款	46,938,639.74	-	35,310,336.17	82,248,975.91
2.基金赎回款	-53,714,255.90	-	-41,366,857.54	-95,081,113.44
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	339,238,047.23	-	232,431,067.36	571,669,114.59
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产(基金净值)	272,359,058.06	-	267,475,385.73	539,834,443.79
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期初净资产(基金净值)	272,359,058.06	-	267,475,385.73	539,834,443.79
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	73,175,979.38	-	-4,144,305.35	69,031,674.03
(一)、综合收益总额	-	-	-59,756,878.03	-59,756,878.03
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	73,175,979.38	-	55,612,572.68	128,788,552.06
其中:1.基金申购款	369,415,412.67	-	310,834,722.88	680,250,135.55
2.基金赎回款	-296,239,433.29	-	-255,222,150.20	-551,461,583.49
(三)、本期向基金份额持有	-	-	-	-

人分配 利润产 生的基 金净值 变动(净 值减少 以“-” 号填列)				
(四)、 其他综 合收益 结转留 存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	345,535,037.44	-	263,331,080.38	608,866,117.82

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 500 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 证监许可 [2009] 第 1374 号《关于核准鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 募集的批复》核准, 由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,629,831,732.31 元, 业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字 (2009) 第 021 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2010 年 2 月 5 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 2,630,723,634.12 份基金份额, 其中认购资金利息折合 891,901.81 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14 号）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年的经营成果和基金净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务

操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	41,110,310.96
等于：本金	41,106,809.88
加：应计利息	3,501.08
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	41,110,310.96

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	565,233,516.13	-	529,821,228.82	-35,412,287.31
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	565,233,516.13	-	529,821,228.82	-35,412,287.31

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

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.8 其他资产

注：无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	305.39
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	139,768.13
其中：交易所市场	139,768.13
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,178.95
应付指数使用费	50,000.00

合计	289,252.47
----	------------

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	316,116,501.17	316,116,501.17
本期申购	24,882,574.68	24,882,574.68
本期赎回 (以“-”号填列)	-24,071,818.86	-24,071,818.86
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	316,927,256.99	316,927,256.99

## 鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	29,897,162.22	29,897,162.22
本期申购	22,056,065.06	22,056,065.06
本期赎回 (以“-”号填列)	-29,642,437.04	-29,642,437.04
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	22,310,790.24	22,310,790.24

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	432,554,449.72	-235,013,081.03	197,541,368.69
本期利润	-1,682,788.70	19,529,360.38	17,846,571.68
本期基金份额交易产生的变动数	1,083,342.16	-1,025,738.48	57,603.68
其中：基金申购款	33,982,750.15	-16,349,837.01	17,632,913.14
基金赎回款	-32,899,407.99	15,324,098.53	-17,575,309.46
本期已分配利润	-	-	-

本期末	431,955,003.18	-216,509,459.13	215,445,544.05
-----	----------------	-----------------	----------------

## 鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,460,332.63	633,734.24	21,094,066.87
本期利润	-162,762.62	2,168,344.11	2,005,581.49
本期基金份额交易产生的变动数	-5,197,417.76	-916,707.29	-6,114,125.05
其中：基金申购款	15,058,785.79	2,618,637.24	17,677,423.03
基金赎回款	-20,256,203.55	-3,535,344.53	-23,791,548.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,100,152.25	1,885,371.06	16,985,523.31

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	71,185.30
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,249.06
其他	1,139.81
合计	73,574.17

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,243,689.49
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-5,243,689.49

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	99,263,053.41
减：卖出股票成本总额	104,229,172.56
减：交易费用	277,570.34
买卖股票差价收入	-5,243,689.49

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,138,661.00
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,138,661.00

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	21,697,704.49
股票投资	21,697,704.49
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
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	21,697,704.49

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	33,089.10
基金转换费收入	529.63
合计	33,618.73

**6.4.7.22 信用减值损失**

注：无。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	320.00
指数使用费	100,000.00
存托服务费	170.70
合计	199,669.65

## 6.4.7.24 分部报告

无。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

无。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
-------	---------------------------------------	--

	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
国信证券	-	-	72,067,771.01	7.03

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	67,088.15	7.09	11,171.53	3.95

注：(1) 佣金的计算公式

上海/深圳证券交易所的交易佣金=股票买(卖)成交金额×佣金比率-买(卖)经手费-买(卖)证管费等由券商承担的费用

(佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。)

(2) 本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和约定的佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为鹏华基金公司提供研究服务以及其他研究支持。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,169,187.21	1,939,075.89

其中: 支付销售机构的客户维护费	457,356.19	459,101.69
------------------	------------	------------

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

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	433,837.47	387,815.19

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)	合计
国信证券	-	83.04	83.04
鹏华基金公司	-	21,353.09	21,353.09
合计	-	21,436.13	21,436.13
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)	合计
国信证券	-	6.38	6.38
鹏华基金公司	-	5,604.38	5,604.38
合计	-	5,610.76	5,610.76

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

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：无。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：无。

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

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	41,110,310.96	71,185.30	35,423,998.82	65,775.67

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
国信证券	301488	豪恩汽电	网下申购	2,618	104,144.04
国信证券	688307	中润光学	网下申购	2,455	58,625.40
国信证券	688562	航天软件	网下申购	7,254	91,980.72
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额

国信证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

注：本表包含参与基金托管人的关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	736	8,743.68	15,470.72	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-

301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	508	15,351.76	12,954.00	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	44.18	25.10	338	10,647.38	8,483.80	科源制药于2023年5月26日每10股送4股
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	38.13	31.03	542	20,666.46	16,818.26	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股流通受限	26.80	22.32	989	26,505.20	22,074.48	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-

301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	131.11	53.24	237	20,715.38	12,617.88	绿通科技于 2023 年 5 月 25 日每 10 股送 5 股
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	76.80	107.95	273	20,966.40	29,470.35	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,025	15,180.25	14,073.25	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	209	15,351.05	9,747.76	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	23.77	42.89	619	14,713.63	26,548.91	-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-

301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流 通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301386	未来 电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301399	英特 科技	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流 通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人 健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股流 通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱 德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股流 通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪 恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股流 通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋 电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流 通受限	19.99	16.90	737	14,732.63	12,455.30	-
301486	致尚 科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	57.66	57.66	2,879	166,003.14	166,003.14	-
301486	致尚 科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流 通受限	57.66	57.66	320	18,451.20	18,451.20	-
301488	豪恩 汽电	2023 年 6 月 26 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩 汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股流 通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601061	中信 金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流 通受限	6.58	7.58	1,669	10,982.02	12,651.02	-
601065	江盐 集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流 通受限	10.36	11.84	547	5,666.92	6,476.48	-
601133	柏诚 股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流 通受限	11.66	12.26	482	5,620.12	5,909.32	-
603125	常青 科技	2023 年 3 月 30	6 个月	新股流 通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-

		日									
603135	中重科技	2023年 3月29日	6个月	新股流 通受限	17.80	17.89	552	9,825.60	9,875.28	-	
603137	恒尚节能	2023年 4月10日	6个月	新股流 通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-	
603172	万丰股份	2023年 4月28日	6个月	新股流 通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-	
688146	中船特气	2023年 4月13日	6个月	新股流 通受限	36.15	38.13	537	19,412.55	20,475.81	-	
688249	晶合集成	2023年 4月24日	6个月	新股流 通受限	19.86	18.06	2,950	58,587.00	53,277.00	-	
688307	中润光学	2023年 2月8日	6个月	新股流 通受限	23.88	31.73	2,455	58,625.40	77,897.15	-	
688334	西高院	2023年 6月9日	6个月	新股流 通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-	
688352	颀中科技	2023年 4月11日	6个月	新股流 通受限	12.10	12.07	1,464	17,714.40	17,670.48	-	
688361	中科飞测-U	2023年 5月12日	6个月	新股流 通受限	23.60	64.67	542	12,791.20	35,051.14	-	
688429	时创能源	2023年 6月20日	6个月	新股流 通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-	
688433	华曙高科	2023年 4月7日	6个月	新股流 通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-	
688443	智翔金泰-U	2023年 6月13日	6个月	新股流 通受限	37.88	29.49	798	30,228.24	23,533.02	-	
688458	美芯晟	2023年 5月15日	6个月	新股流 通受限	75.00	90.76	194	14,550.00	17,607.44	-	
688469	中芯集成-U	2023年 4月28日	6个月	新股流 通受限	5.69	5.41	5,444	30,976.36	29,452.04	-	
688472	阿特	2023年	6个月	新股流	11.10	17.04	2,038	22,621.80	34,727.52	-	

	斯	6月2日		通受限							
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74		-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68		-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	245.56	122.11	121	20,135.92	14,775.31	索辰科技于2023年6月20日每10股送4.8股	
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20		-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股流通受限	152.38	135.97	173	26,361.74	23,522.81		-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03		-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	318	13,887.06	16,869.90		-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06		-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	584	17,671.84	14,792.72		-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	135	16,983.00	15,934.05		-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	420	11,230.80	17,085.60		-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81		-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00		-

688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	331	8,367.68	9,886.97	-

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票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

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

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

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

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

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项	6.97	2023年7月3日	7.40	50,800	293,842.71	354,076.00	-
000540	*ST中天	2023年5月19日	退市	0.11	-	-	377,100	823,694.89	41,481.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，

及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2022 年 12 月 31 日：未持有）。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

于 2023 年 6 月 30 日, 本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值 (净资产) 无固定到期日且不计息, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注: 无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

同时, 本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度; 按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	41,110,310.96	-	-	-	41,110,310.96
存出保证金	20,092.69	-	-	-	20,092.69
交易性金融资产	-	-	-	529,821,228.82	529,821,228.82
应收申购款	-	-	-	1,591,660.50	1,591,660.50
应收清算款	-	-	-	1,188.19	1,188.19
资产总计	41,130,403.65	-	-	531,414,077.51	572,544,481.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	161,226.40	161,226.40
应付管理人报酬	-	-	-	348,635.94	348,635.94
应付托管费	-	-	-	69,727.19	69,727.19
应付清算款	-	-	-	0.91	0.91
应付销售服务费	-	-	-	6,523.66	6,523.66
其他负债	-	-	-	289,252.47	289,252.47
负债总计	-	-	-	875,366.57	875,366.57
利率敏感度缺口	41,130,403.65	-	-	530,538,710.94	571,669,114.59
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2022 年 12 月 31 日				
资产				
银行存款	37,826,255.80	-	-	37,826,255.80
结算备付金	207,623.85	-	-	207,623.85
存出保证金	41,244.44	-	-	41,244.44
交易性金融资产	-	-	-526,495,521.19	526,495,521.19
应收申购款	-	-	1,305,254.23	1,305,254.23
应收清算款	-	-	213,101.02	213,101.02
资产总计	38,075,124.09	-	-528,013,876.44	566,089,000.53
负债				
应付赎回款	-	-	503,396.82	503,396.82
应付管理人报酬	-	-	360,454.52	360,454.52
应付托管费	-	-	72,090.92	72,090.92
应付销售服务费	-	-	6,879.85	6,879.85
其他负债	-	-	497,079.47	497,079.47
负债总计	-	-	1,439,901.58	1,439,901.58
利率敏感度缺口	38,075,124.09	-	-526,573,974.86	564,649,098.95

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%。因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个券在标的指数中的基准权重

构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份券及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	529,821,228.82	92.68	526,495,521.19	93.24
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	529,821,228.82	92.68	526,495,521.19	93.24

注：债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)		
	本期末 (2023 年 6 月 30 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)	
分析	业绩比较基准上升	26,559,747.06	26,473,573.00

	5%		
	业绩比较基准下降	-26,559,747.06	-26,473,573.00
	5%		

注：无。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日
第一层次	527,718,695.38
第二层次	987,414.04
第三层次	1,115,119.40
合计	529,821,228.82

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

## 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

## 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	529,821,228.82	92.54
	其中：股票	529,821,228.82	92.54
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	41,110,310.96	7.18
8	其他各项资产	1,612,941.38	0.28
9	合计	572,544,481.16	100.00

注：报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：1,223,456.85 元，占净值比 0.21%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,731,831.40	0.65
B	采矿业	19,452,601.34	3.40
C	制造业	329,745,900.81	57.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,200,468.00	3.18
E	建筑业	5,889,761.50	1.03

F	批发和零售业	16,629,040.33	2.91
G	交通运输、仓储和邮政业	7,860,665.26	1.38
H	住宿和餐饮业	985,400.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	43,172,285.10	7.55
J	金融业	45,291,275.40	7.92
K	房地产业	6,953,505.97	1.22
L	租赁和商务服务业	6,454,621.00	1.13
M	科学研究和技术服务业	5,902,323.00	1.03
N	水利、环境和公共设施管理业	2,913,790.35	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,648,545.60	0.46
R	文化、体育和娱乐业	7,448,890.00	1.30
S	综合	2,785,242.89	0.49
	合计	526,066,147.95	92.02

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,169,922.49	0.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	8,284.83	0.00
F	批发和零售业	61,522.99	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	104,549.10	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	306,669.00	0.05
L	租赁和商务服务业	7,660.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	37,242.13	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,755,080.87	0.66

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	49,900	7,357,755.00	1.29
2	688256	寒武纪-U	16,245	3,054,060.00	0.53
3	000988	华工科技	77,850	2,959,078.50	0.52
4	002340	格林美	404,800	2,797,168.00	0.49
5	002384	东山精密	106,000	2,745,400.00	0.48
6	002422	科伦药业	91,700	2,721,656.00	0.48
7	600372	中航电子	174,900	2,654,982.00	0.46
8	300418	昆仑万维	65,000	2,618,200.00	0.46
9	300012	华测检测	130,800	2,550,600.00	0.45
10	600157	永泰能源	1,733,600	2,461,712.00	0.43
11	300724	捷佳伟创	21,600	2,426,760.00	0.42
12	600079	人福医药	89,000	2,397,660.00	0.42
13	600489	中金黄金	226,200	2,336,646.00	0.41
14	300003	乐普医疗	102,800	2,324,308.00	0.41
15	688777	中控技术	36,328	2,280,671.84	0.40
16	002738	中矿资源	44,320	2,257,660.80	0.39
17	600487	亨通光电	152,900	2,241,514.00	0.39
18	002028	思源电气	47,224	2,206,305.28	0.39
19	600536	中国软件	46,815	2,194,687.20	0.38
20	601058	赛轮轮胎	190,100	2,165,239.00	0.38
21	601555	东吴证券	311,880	2,164,447.20	0.38
22	002463	沪电股份	103,000	2,156,820.00	0.38
23	600765	中航重机	79,593	2,110,010.43	0.37
24	300037	新宙邦	40,520	2,102,582.80	0.37
25	000066	中国长城	149,500	2,067,585.00	0.36
26	000807	云铝股份	162,100	2,063,533.00	0.36
27	600885	宏发股份	64,212	2,045,152.20	0.36

28	600482	中国动力	83,800	1,964,272.00	0.34
29	000009	中国宝安	160,480	1,936,993.60	0.34
30	300146	汤臣倍健	79,800	1,913,604.00	0.33
31	600352	浙江龙盛	204,600	1,913,010.00	0.33
32	000423	东阿阿胶	35,600	1,902,820.00	0.33
33	688099	晶晨股份	22,396	1,888,430.72	0.33
34	601108	财通证券	257,900	1,867,196.00	0.33
35	300058	蓝色光标	193,000	1,866,310.00	0.33
36	002156	通富微电	81,900	1,850,940.00	0.32
37	002966	苏州银行	282,280	1,848,934.00	0.32
38	002185	华天科技	197,800	1,819,760.00	0.32
39	002625	光启技术	117,800	1,797,628.00	0.31
40	600415	小商品城	210,600	1,796,418.00	0.31
41	002624	完美世界	105,600	1,783,584.00	0.31
42	000783	长江证券	306,700	1,778,860.00	0.31
43	300144	宋城演艺	142,800	1,770,720.00	0.31
44	600109	国金证券	203,800	1,766,946.00	0.31
45	601233	桐昆股份	132,100	1,750,325.00	0.31
46	600027	华电国际	261,400	1,748,766.00	0.31
47	600161	天坛生物	64,400	1,748,460.00	0.31
48	600988	赤峰黄金	129,000	1,736,340.00	0.30
49	601077	渝农商行	482,900	1,733,611.00	0.30
50	600298	安琪酵母	47,600	1,723,596.00	0.30
51	002008	大族激光	65,700	1,721,340.00	0.30
52	300285	国瓷材料	62,400	1,709,760.00	0.30
53	600096	云天化	100,100	1,708,707.00	0.30
54	600418	江淮汽车	135,668	1,708,060.12	0.30
55	002385	大北农	257,400	1,698,840.00	0.30
56	300568	星源材质	98,600	1,694,934.00	0.30
57	002223	鱼跃医疗	46,905	1,688,110.95	0.30
58	000630	铜陵有色	575,200	1,662,328.00	0.29
59	002407	多氟多	83,120	1,650,763.20	0.29
60	603882	金域医学	21,800	1,645,900.00	0.29
61	600862	中航高科	64,600	1,635,026.00	0.29
62	300390	天华新能	45,480	1,628,184.00	0.28
63	601162	天风证券	544,400	1,622,312.00	0.28
64	603444	吉比特	3,300	1,620,663.00	0.28
65	002409	雅克科技	22,200	1,617,936.00	0.28
66	300024	机器人	95,900	1,598,653.00	0.28
67	002497	雅化集团	89,600	1,593,088.00	0.28
68	000933	神火股份	122,500	1,592,500.00	0.28
69	603688	石英股份	13,900	1,582,376.00	0.28
70	002240	盛新锂能	49,600	1,580,752.00	0.28

71	601168	西部矿业	149,900	1,575,449.00	0.28
72	300474	景嘉微	17,500	1,574,825.00	0.28
73	600705	中航产融	410,500	1,572,215.00	0.28
74	300395	菲利华	31,700	1,559,640.00	0.27
75	000932	华菱钢铁	326,960	1,559,599.20	0.27
76	300604	长川科技	32,680	1,551,973.20	0.27
77	300073	当升科技	30,800	1,550,164.00	0.27
78	002439	启明星辰	51,800	1,541,568.00	0.27
79	605358	立昂微	41,600	1,527,968.00	0.27
80	002797	第一创业	265,500	1,518,660.00	0.27
81	600066	宇通客车	102,800	1,515,272.00	0.27
82	002600	领益智造	218,700	1,511,217.00	0.26
83	000975	银泰黄金	129,020	1,509,534.00	0.26
84	603596	伯特利	19,000	1,505,940.00	0.26
85	600060	海信视像	60,700	1,502,325.00	0.26
86	300136	信维通信	74,600	1,497,968.00	0.26
87	002138	顺络电子	62,100	1,484,811.00	0.26
88	002568	百润股份	40,600	1,475,810.00	0.26
89	002465	海格通信	142,100	1,469,314.00	0.26
90	603816	顾家家居	38,300	1,461,145.00	0.26
91	603939	益丰药房	39,240	1,451,880.00	0.25
92	600873	梅花生物	162,400	1,450,232.00	0.25
93	600879	航天电子	170,400	1,446,696.00	0.25
94	000021	深科技	72,256	1,444,397.44	0.25
95	600839	四川长虹	286,000	1,444,300.00	0.25
96	300253	卫宁健康	133,400	1,443,388.00	0.25
97	601128	常熟银行	211,600	1,443,112.00	0.25
98	600160	巨化股份	104,680	1,442,490.40	0.25
99	300832	新产业	24,300	1,433,700.00	0.25
100	000591	太阳能	211,200	1,431,936.00	0.25
101	002850	科达利	10,800	1,428,300.00	0.25
102	600563	法拉电子	10,323	1,417,347.90	0.25
103	000683	远兴能源	196,400	1,412,116.00	0.25
104	688169	石头科技	4,400	1,410,992.00	0.25
105	600392	盛和资源	109,429	1,408,351.23	0.25
106	601990	南京证券	172,000	1,406,960.00	0.25
107	688567	孚能科技	65,000	1,403,350.00	0.25
108	002078	太阳纸业	130,928	1,399,620.32	0.24
109	300699	光威复材	45,180	1,393,803.00	0.24
110	002368	太极股份	33,797	1,391,422.49	0.24
111	688521	芯原股份	19,300	1,388,056.00	0.24
112	600497	驰宏锌锗	276,200	1,386,524.00	0.24
113	603589	口子窖	27,900	1,376,865.00	0.24

114	601696	中银证券	128,900	1,374,074.00	0.24
115	300866	安克创新	15,700	1,373,750.00	0.24
116	000729	燕京啤酒	109,300	1,362,971.00	0.24
117	600516	方大炭素	218,400	1,354,080.00	0.24
118	300118	东方日升	52,800	1,353,264.00	0.24
119	000831	中国稀土	45,600	1,349,760.00	0.24
120	600177	雅戈尔	213,600	1,347,816.00	0.24
121	002294	信立泰	43,200	1,347,408.00	0.24
122	002025	航天电器	21,100	1,346,180.00	0.24
123	600141	兴发集团	60,418	1,342,487.96	0.23
124	300017	网宿科技	188,400	1,339,524.00	0.23
125	002673	西部证券	210,300	1,335,405.00	0.23
126	688390	固德威	7,976	1,330,875.36	0.23
127	000728	国元证券	203,900	1,329,428.00	0.23
128	600642	申能股份	188,700	1,319,013.00	0.23
129	600699	均胜电子	74,760	1,318,766.40	0.23
130	600170	上海建工	487,500	1,311,375.00	0.23
131	000629	钒钛股份	335,100	1,310,241.00	0.23
132	002430	杭氧股份	38,000	1,305,680.00	0.23
133	600118	中国卫星	46,200	1,303,302.00	0.23
134	002532	天山铝业	217,300	1,301,627.00	0.23
135	002739	万达电影	102,900	1,290,366.00	0.23
136	600143	金发科技	147,400	1,286,802.00	0.23
137	688072	拓荆科技	3,000	1,277,910.00	0.22
138	002195	二三四五	442,121	1,277,729.69	0.22
139	002273	水晶光电	106,984	1,277,388.96	0.22
140	600521	华海药业	69,300	1,275,813.00	0.22
141	601966	玲珑轮胎	57,300	1,273,206.00	0.22
142	600166	福田汽车	374,200	1,272,280.00	0.22
143	002372	伟星新材	61,920	1,271,836.80	0.22
144	600549	厦门钨业	66,800	1,271,204.00	0.22
145	002268	电科网安	45,580	1,270,314.60	0.22
146	600325	华发股份	128,475	1,265,478.75	0.22
147	300595	欧普康视	41,800	1,261,942.00	0.22
148	600486	扬农化工	14,400	1,258,848.00	0.22
149	000998	隆平高科	82,004	1,258,761.40	0.22
150	600637	东方明珠	160,500	1,255,110.00	0.22
151	600153	建发股份	115,000	1,254,650.00	0.22
152	603000	人民网	42,900	1,252,680.00	0.22
153	000400	许继电气	54,100	1,247,005.00	0.22
154	600399	抚顺特钢	121,800	1,242,360.00	0.22
155	000738	航发控制	50,800	1,239,520.00	0.22
156	002065	东华软件	175,400	1,238,324.00	0.22

157	688002	睿创微纳	27,416	1,228,236.80	0.21
158	601198	东兴证券	152,600	1,223,852.00	0.21
159	689009	九号公司-WD	33,201	1,223,456.85	0.21
160	688536	思瑞浦	5,600	1,220,800.00	0.21
161	002444	巨星科技	55,795	1,220,794.60	0.21
162	000997	新大陆	64,486	1,218,785.40	0.21
163	600859	王府井	61,449	1,216,075.71	0.21
164	300487	蓝晓科技	19,450	1,214,069.00	0.21
165	600481	双良节能	86,600	1,210,668.00	0.21
166	002131	利欧股份	525,840	1,209,432.00	0.21
167	688220	翱捷科技-U	16,000	1,206,240.00	0.21
168	002353	杰瑞股份	47,900	1,203,727.00	0.21
169	600499	科达制造	105,800	1,201,888.00	0.21
170	601997	贵阳银行	232,800	1,201,248.00	0.21
171	601577	长沙银行	154,700	1,200,472.00	0.21
172	600704	物产中大	242,800	1,199,432.00	0.21
173	600271	航天信息	87,600	1,199,244.00	0.21
174	000960	锡业股份	76,600	1,191,130.00	0.21
175	300383	光环新网	110,700	1,190,025.00	0.21
176	300682	朗新科技	51,100	1,189,608.00	0.21
177	000623	吉林敖东	73,800	1,183,752.00	0.21
178	300438	鹏辉能源	24,600	1,181,784.00	0.21
179	603077	和邦生物	483,080	1,173,884.40	0.21
180	002373	千方科技	85,814	1,170,502.96	0.20
181	600021	上海电力	108,500	1,168,545.00	0.20
182	000519	中兵红箭	64,408	1,165,140.72	0.20
183	600380	健康元	91,448	1,162,304.08	0.20
184	000703	恒逸石化	170,800	1,158,024.00	0.20
185	300676	华大基因	19,300	1,157,807.00	0.20
186	300001	特锐德	55,700	1,157,446.00	0.20
187	300088	长信科技	191,200	1,152,936.00	0.20
188	600867	通化东宝	110,200	1,150,488.00	0.20
189	688009	中国通号	198,269	1,149,960.20	0.20
190	002507	涪陵榨菜	62,805	1,149,959.55	0.20
191	000513	丽珠集团	29,520	1,148,623.20	0.20
192	002056	横店东磁	62,908	1,145,554.68	0.20
193	002203	海亮股份	94,800	1,138,548.00	0.20
194	600511	国药股份	29,292	1,137,994.20	0.20
195	600529	山东药玻	41,300	1,124,186.00	0.20
196	600998	九州通	108,025	1,121,299.50	0.20
197	601016	节能风电	305,200	1,120,084.00	0.20
198	002152	广电运通	95,200	1,115,744.00	0.20
199	002281	光迅科技	30,060	1,114,925.40	0.20

200	600546	山煤国际	76,900	1,112,743.00	0.19
201	002299	圣农发展	58,000	1,110,700.00	0.19
202	688301	奕瑞科技	3,920	1,107,125.60	0.19
203	600348	华阳股份	139,900	1,106,609.00	0.19
204	600498	烽火通信	54,200	1,104,054.00	0.19
205	600739	辽宁成大	83,500	1,098,025.00	0.19
206	603338	浙江鼎力	19,600	1,097,796.00	0.19
207	000636	风华高科	71,300	1,093,742.00	0.19
208	688516	奥特维	5,800	1,092,720.00	0.19
209	603517	绝味食品	29,300	1,088,495.00	0.19
210	002595	豪迈科技	30,900	1,085,517.00	0.19
211	603712	七一二	35,700	1,078,497.00	0.19
212	601636	旗滨集团	125,000	1,077,500.00	0.19
213	002080	中材科技	52,500	1,077,300.00	0.19
214	603737	三棵树	16,400	1,072,888.00	0.19
215	000878	云南铜业	97,000	1,071,850.00	0.19
216	002192	融捷股份	16,000	1,069,280.00	0.19
217	002506	协鑫集成	362,100	1,060,953.00	0.19
218	603885	吉祥航空	68,500	1,056,955.00	0.18
219	603927	中科软	27,380	1,055,772.80	0.18
220	600580	卧龙电驱	71,886	1,050,254.46	0.18
221	002432	九安医疗	29,800	1,049,258.00	0.18
222	600863	内蒙华电	252,800	1,049,120.00	0.18
223	002531	天顺风能	68,700	1,046,301.00	0.18
224	600655	豫园股份	152,500	1,046,150.00	0.18
225	600970	中材国际	82,050	1,046,137.50	0.18
226	688772	珠海冠宇	51,600	1,039,740.00	0.18
227	600820	隧道股份	172,900	1,039,129.00	0.18
228	002683	广东宏大	35,100	1,033,344.00	0.18
229	300182	捷成股份	163,400	1,031,054.00	0.18
230	002092	中泰化学	159,468	1,028,568.60	0.18
231	600909	华安证券	220,150	1,028,100.50	0.18
232	300212	易华录	30,920	1,027,471.60	0.18
233	002939	长城证券	126,200	1,026,006.00	0.18
234	600008	首创环保	355,830	1,024,790.40	0.18
235	300296	利亚德	156,700	1,023,251.00	0.18
236	688385	复旦微电	20,400	1,022,040.00	0.18
237	002926	华西证券	122,100	1,014,651.00	0.18
238	600528	中铁工业	102,500	1,012,700.00	0.18
239	000750	国海证券	301,880	1,011,298.00	0.18
240	600535	天士力	69,600	1,009,896.00	0.18
241	300244	迪安诊断	39,120	1,002,645.60	0.18
242	000039	中集集团	145,180	1,000,290.20	0.17

243	603233	大参林	35,464	993,346.64	0.17
244	600258	首旅酒店	52,000	985,400.00	0.17
245	000547	航天发展	98,300	983,000.00	0.17
246	000893	亚钾国际	42,800	981,832.00	0.17
247	600329	达仁堂	21,862	981,385.18	0.17
248	300748	金力永磁	32,700	978,384.00	0.17
249	002557	洽洽食品	23,500	976,425.00	0.17
250	603160	汇顶科技	21,100	975,875.00	0.17
251	603156	养元饮品	39,300	970,710.00	0.17
252	002429	兆驰股份	176,300	969,650.00	0.17
253	000060	中金岭南	202,600	962,350.00	0.17
254	600416	湘电股份	50,400	962,136.00	0.17
255	000970	中科三环	74,625	956,692.50	0.17
256	002500	山西证券	170,970	954,012.60	0.17
257	601880	辽港股份	610,622	952,570.32	0.17
258	600369	西南证券	260,100	949,365.00	0.17
259	688200	华峰测控	6,200	948,600.00	0.17
260	000830	鲁西化工	89,827	948,573.12	0.17
261	601991	大唐发电	284,500	941,695.00	0.16
262	603658	安图生物	18,200	941,486.00	0.16
263	603456	九洲药业	34,300	939,134.00	0.16
264	600390	五矿资本	174,000	936,120.00	0.16
265	002508	老板电器	37,000	935,730.00	0.16
266	603893	瑞芯微	12,800	932,480.00	0.16
267	002128	电投能源	70,500	932,010.00	0.16
268	300558	贝达药业	19,400	931,782.00	0.16
269	300009	安科生物	92,772	927,720.00	0.16
270	600435	北方导航	80,672	926,921.28	0.16
271	002936	郑州银行	402,657	926,111.10	0.16
272	600398	海澜之家	134,000	921,920.00	0.16
273	600038	中直股份	23,000	915,860.00	0.16
274	300070	碧水源	168,100	901,016.00	0.16
275	601717	郑煤机	72,205	898,952.25	0.16
276	600985	淮北矿业	77,400	891,648.00	0.16
277	300026	红日药业	162,600	881,292.00	0.15
278	002153	石基信息	62,922	880,908.00	0.15
279	300529	健帆生物	37,600	871,568.00	0.15
280	603858	步长制药	42,200	868,898.00	0.15
281	600848	上海临港	72,400	865,180.00	0.15
282	002572	索菲亚	49,500	862,290.00	0.15
283	600673	东阳光	117,649	848,249.29	0.15
284	000050	深天马 A	92,100	845,478.00	0.15
285	601179	中国西电	156,200	845,042.00	0.15

286	601456	国联证券	92,800	844,480.00	0.15
287	603127	昭衍新药	20,640	844,176.00	0.15
288	002408	齐翔腾达	132,113	841,559.81	0.15
289	002958	青农商行	308,700	839,664.00	0.15
290	600827	百联股份	62,700	838,299.00	0.15
291	003035	南网能源	117,600	837,312.00	0.15
292	600566	济川药业	28,800	836,352.00	0.15
293	688779	长远锂科	74,200	836,234.00	0.15
294	688188	柏楚电子	4,430	835,320.80	0.15
295	601958	金钼股份	74,800	834,020.00	0.15
296	002019	亿帆医药	57,000	832,200.00	0.15
297	300373	扬杰科技	20,500	831,685.00	0.15
298	002244	滨江集团	94,092	829,891.44	0.15
299	002266	浙富控股	199,340	823,274.20	0.14
300	600895	张江高科	59,100	822,672.00	0.14
301	300357	我武生物	24,400	820,572.00	0.14
302	600282	南钢股份	242,700	817,899.00	0.14
303	000155	川能动力	56,700	816,480.00	0.14
304	600667	太极实业	112,400	816,024.00	0.14
305	000739	普洛药业	45,600	808,944.00	0.14
306	600208	新湖中宝	324,800	805,504.00	0.14
307	688116	天奈科技	17,600	805,200.00	0.14
308	603267	鸿远电子	12,300	803,190.00	0.14
309	000887	中鼎股份	60,900	797,181.00	0.14
310	601666	平煤股份	105,600	796,224.00	0.14
311	688538	和辉光电-U	313,400	796,036.00	0.14
312	600171	上海贝岭	43,562	795,006.50	0.14
313	600959	江苏有线	234,600	792,948.00	0.14
314	002155	湖南黄金	64,900	791,780.00	0.14
315	601000	唐山港	224,098	791,065.94	0.14
316	600315	上海家化	27,113	786,548.13	0.14
317	600755	厦门国贸	101,613	786,484.62	0.14
318	600378	昊华科技	20,800	782,912.00	0.14
319	600316	洪都航空	33,300	780,885.00	0.14
320	300888	稳健医疗	18,640	776,728.80	0.14
321	300677	英科医疗	35,260	775,720.00	0.14
322	002670	国盛金控	88,320	775,449.60	0.14
323	300115	长盈精密	64,702	770,600.82	0.13
324	000598	兴蓉环境	140,700	764,001.00	0.13
325	601231	环旭电子	50,900	761,464.00	0.13
326	601866	中远海发	308,100	761,007.00	0.13
327	600598	北大荒	57,000	759,810.00	0.13
328	000778	新兴铸管	185,900	758,472.00	0.13

329	002030	达安基因	75,888	756,603.36	0.13
330	600131	国网信通	37,300	753,087.00	0.13
331	000987	越秀资本	117,480	745,998.00	0.13
332	002221	东华能源	86,118	744,920.70	0.13
333	600517	国网英大	130,600	744,420.00	0.13
334	600582	天地科技	127,645	744,170.35	0.13
335	600056	中国医药	57,312	743,909.76	0.13
336	002487	大金重工	24,100	743,244.00	0.13
337	603218	日月股份	39,100	742,509.00	0.13
338	000027	深圳能源	112,600	742,034.00	0.13
339	603026	胜华新材	12,500	740,625.00	0.13
340	300363	博腾股份	25,000	739,750.00	0.13
341	300251	光线传媒	91,200	737,808.00	0.13
342	000709	河钢股份	324,700	733,822.00	0.13
343	688082	盛美上海	6,600	728,640.00	0.13
344	002326	永太科技	47,100	720,159.00	0.13
345	002249	大洋电机	126,050	718,485.00	0.13
346	600906	财达证券	99,600	717,120.00	0.13
347	002518	科士达	17,800	712,178.00	0.12
348	002183	怡亚通	139,600	711,960.00	0.12
349	601992	金隅集团	326,000	710,680.00	0.12
350	601106	中国一重	211,200	709,632.00	0.12
351	002690	美亚光电	27,390	705,292.50	0.12
352	002511	中顺洁柔	63,200	704,680.00	0.12
353	601005	重庆钢铁	503,300	704,620.00	0.12
354	002831	裕同科技	28,760	701,456.40	0.12
355	600718	东软集团	64,700	689,702.00	0.12
356	000883	湖北能源	151,100	689,016.00	0.12
357	601778	晶科科技	139,300	688,142.00	0.12
358	000825	太钢不锈	177,700	687,699.00	0.12
359	601665	齐鲁银行	175,400	687,568.00	0.12
360	603568	伟明环保	39,265	687,530.15	0.12
361	600373	中文传媒	51,600	687,312.00	0.12
362	603883	老百姓	22,894	683,385.90	0.12
363	002985	北摩高科	15,373	678,256.76	0.12
364	600967	内蒙一机	67,000	676,700.00	0.12
365	300776	帝尔激光	10,340	671,066.00	0.12
366	600737	中粮糖业	83,300	670,565.00	0.12
367	601928	凤凰传媒	58,300	664,620.00	0.12
368	603228	景旺电子	25,788	661,462.20	0.12
369	600871	石化油服	332,900	659,142.00	0.12
370	600663	陆家嘴	66,700	658,329.00	0.12
371	603225	新凤鸣	59,120	653,276.00	0.11

372	000012	南玻 A	109,538	652,846.48	0.11
373	600297	广汇汽车	313,200	651,456.00	0.11
374	600801	华新水泥	52,730	651,215.50	0.11
375	688281	华秦科技	3,200	648,000.00	0.11
376	601098	中南传媒	55,300	641,480.00	0.11
377	603529	爱玛科技	19,900	641,178.00	0.11
378	002791	坚朗五金	9,900	640,629.00	0.11
379	002468	申通快递	59,100	639,462.00	0.11
380	600155	华创云信	102,500	637,550.00	0.11
381	300861	美畅股份	14,700	637,539.00	0.11
382	300482	万孚生物	23,850	635,125.50	0.11
383	002032	苏泊尔	12,700	635,000.00	0.11
384	688778	厦钨新能	12,800	633,600.00	0.11
385	688208	道通科技	20,860	632,266.60	0.11
386	603866	桃李面包	62,267	630,142.04	0.11
387	000156	华数传媒	71,900	625,530.00	0.11
388	001227	兰州银行	216,900	620,334.00	0.11
389	002745	木林森	67,300	619,160.00	0.11
390	600500	中化国际	110,800	616,048.00	0.11
391	000785	居然之家	159,600	608,076.00	0.11
392	002867	周大生	34,150	607,187.00	0.11
393	000401	冀东水泥	82,000	604,340.00	0.11
394	000581	威孚高科	38,300	603,225.00	0.11
395	601118	海南橡胶	134,500	602,560.00	0.11
396	000930	中粮科技	74,247	601,400.70	0.11
397	600022	山东钢铁	423,050	600,731.00	0.11
398	688690	纳微科技	15,400	598,290.00	0.10
399	601611	中国核建	70,800	598,260.00	0.10
400	600556	天下秀	83,600	592,724.00	0.10
401	000559	万向钱潮	108,300	590,235.00	0.10
402	301029	怡合达	13,180	588,882.40	0.10
403	688276	百克生物	9,400	588,440.00	0.10
404	002250	联化科技	56,149	587,318.54	0.10
405	688029	南微医学	7,200	587,232.00	0.10
406	002010	传化智联	109,300	581,476.00	0.10
407	688520	神州细胞-U	10,200	578,748.00	0.10
408	600597	光明乳业	55,500	577,200.00	0.10
409	002081	金螳螂	127,800	576,378.00	0.10
410	002423	中粮资本	70,700	565,600.00	0.10
411	601598	中国外运	120,200	560,132.00	0.10
412	601608	中信重工	132,800	559,088.00	0.10
413	300850	新强联	14,900	556,962.00	0.10
414	600062	华润双鹤	31,912	555,907.04	0.10

415	688006	杭可科技	18,196	554,432.12	0.10
416	601568	北元集团	104,500	550,715.00	0.10
417	600259	广晟有色	15,231	550,448.34	0.10
418	002505	鹏都农牧	290,470	548,988.30	0.10
419	000089	深圳机场	78,600	546,270.00	0.10
420	600782	新钢股份	146,900	544,999.00	0.10
421	600901	江苏金租	131,460	542,929.80	0.09
422	000958	电投产融	125,100	541,683.00	0.09
423	300618	寒锐钴业	16,700	541,247.00	0.09
424	603826	坤彩科技	10,700	535,000.00	0.09
425	603638	艾迪精密	25,920	531,878.40	0.09
426	000937	冀中能源	83,100	530,178.00	0.09
427	600409	三友化工	95,802	522,120.90	0.09
428	600339	中油工程	126,900	516,483.00	0.09
429	000898	鞍钢股份	182,900	508,462.00	0.09
430	688052	纳芯微	3,200	506,784.00	0.09
431	601187	厦门银行	100,900	506,518.00	0.09
432	600095	湘财股份	64,900	506,220.00	0.09
433	600507	方大特钢	109,310	506,105.30	0.09
434	603707	健友股份	37,489	506,101.50	0.09
435	002761	浙江建投	33,100	502,458.00	0.09
436	000967	盈峰环境	99,400	501,970.00	0.09
437	601156	东航物流	38,600	501,800.00	0.09
438	600968	海油发展	162,500	498,875.00	0.09
439	688107	安路科技	9,000	498,510.00	0.09
440	000537	广宇发展	42,700	498,309.00	0.09
441	600167	联美控股	71,280	496,821.60	0.09
442	600707	彩虹股份	104,200	495,992.00	0.09
443	601718	际华集团	166,300	493,911.00	0.09
444	000415	渤海租赁	234,900	493,290.00	0.09
445	000563	陕国投 A	157,532	480,472.60	0.08
446	001914	招商积余	31,800	478,590.00	0.08
447	688234	天岳先进	6,400	473,216.00	0.08
448	002925	盈趣科技	24,340	472,196.00	0.08
449	600808	马钢股份	183,300	471,081.00	0.08
450	300257	开山股份	30,400	461,168.00	0.08
451	002705	新宝股份	25,500	459,765.00	0.08
452	600195	中牧股份	39,071	456,349.28	0.08
453	603650	彤程新材	13,800	452,640.00	0.08
454	600126	杭钢股份	102,500	444,850.00	0.08
455	600764	中国海防	16,300	443,686.00	0.08
456	300442	润泽科技	14,400	442,944.00	0.08
457	603379	三美股份	18,600	437,286.00	0.08

458	000959	首钢股份	124,200	434,700.00	0.08
459	002608	江苏国信	56,400	426,948.00	0.07
460	688185	康希诺	5,200	423,800.00	0.07
461	603786	科博达	6,200	407,340.00	0.07
462	688819	天能股份	11,026	406,197.84	0.07
463	002653	海思科	17,100	403,560.00	0.07
464	000402	金融街	88,300	399,116.00	0.07
465	601828	美凯龙	82,900	397,091.00	0.07
466	002563	森马服饰	63,700	396,214.00	0.07
467	002110	三钢闽光	93,400	394,148.00	0.07
468	001203	大中矿业	34,700	385,517.00	0.07
469	688289	圣湘生物	22,570	380,078.80	0.07
470	601228	广州港	117,200	378,556.00	0.07
471	600623	华谊集团	59,700	371,931.00	0.07
472	600377	宁沪高速	37,600	369,608.00	0.06
473	603056	德邦股份	23,600	363,912.00	0.06
474	600927	永安期货	22,300	362,598.00	0.06
475	603317	天味食品	24,612	359,581.32	0.06
476	601298	青岛港	50,800	354,076.00	0.06
477	600928	西安银行	99,300	349,536.00	0.06
478	601869	长飞光纤	9,100	336,791.00	0.06
479	002399	海普瑞	29,000	332,630.00	0.06
480	000869	张裕 A	10,800	331,128.00	0.06
481	000031	大悦城	90,283	330,435.78	0.06
482	601139	深圳燃气	44,700	325,863.00	0.06
483	601136	首创证券	22,600	320,242.00	0.06
484	601969	海南矿业	47,500	312,550.00	0.05
485	600350	山东高速	46,600	296,842.00	0.05
486	600995	南网储能	26,900	296,169.00	0.05
487	001872	招商港口	16,700	288,409.00	0.05
488	000553	安道麦 A	32,900	277,676.00	0.05
489	601158	重庆水务	49,500	275,220.00	0.05
490	688105	诺唯赞	9,000	274,410.00	0.05
491	002945	华林证券	19,700	269,496.00	0.05
492	600299	安迪苏	32,300	257,431.00	0.05
493	688248	南网科技	6,200	238,018.00	0.04
494	603868	飞科电器	3,600	227,124.00	0.04
495	603355	莱克电气	8,780	223,099.80	0.04
496	688295	中复神鹰	6,000	220,080.00	0.04
497	600956	新天绿能	24,300	211,896.00	0.04
498	300741	华宝股份	9,700	207,774.00	0.04
499	600032	浙江新能	16,100	202,216.00	0.04
500	002901	大博医疗	4,300	133,644.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688041	海光信息	11,563	789,406.01	0.14
2	603606	东方电缆	9,100	446,173.00	0.08
3	002146	荣盛发展	172,200	265,188.00	0.05
4	688582	芯动联科	4,192	193,803.80	0.03
5	301486	致尚科技	3,199	184,454.34	0.03
6	301291	明阳电气	5,419	175,808.46	0.03
7	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.02
8	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
9	688203	海正生材	5,761	79,386.58	0.01
10	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
11	688307	中润光学	2,455	77,897.15	0.01
12	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
13	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
14	688249	晶合集成	2,950	53,277.00	0.01
15	000540	*ST 中天	377,100	41,481.00	0.01
16	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
17	688361	中科飞测-U	542	35,051.14	0.01
18	688472	阿特斯	2,038	34,727.52	0.01
19	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
20	301325	曼恩斯特	273	29,470.35	0.01
21	688469	中芯集成-U	5,444	29,452.04	0.01
22	301358	湖南裕能	619	26,548.91	0.00
23	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
24	688443	智翔金泰-U	798	23,533.02	0.00
25	688531	日联科技	173	23,522.81	0.00
26	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
27	301303	真兰仪表	989	22,074.48	0.00
28	688146	中船特气	537	20,475.81	0.00
29	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
30	688352	颀中科技	1,464	17,670.48	0.00
31	688458	美芯晟	194	17,607.44	0.00
32	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
33	688543	国科军工	318	16,869.90	0.00
34	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
35	688581	安杰思	135	15,934.05	0.00
36	001287	中电港	736	15,470.72	0.00
37	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
38	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
39	688570	天玛智控	584	14,792.72	0.00
40	688507	索辰科技	121	14,775.31	0.00

41	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
42	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
43	301332	德尔玛	1,025	14,073.25	0.00
44	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
45	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
46	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
47	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
48	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
49	301262	海看股份	508	12,954.00	0.00
50	601061	中信金属	1,669	12,651.02	0.00
51	301322	绿通科技	237	12,617.88	0.00
52	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
53	301439	泓淋电力	737	12,455.30	0.00
54	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
55	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
56	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
57	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
58	688631	莱斯信息	331	9,886.97	0.00
59	603135	中重科技	552	9,875.28	0.00
60	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
61	301345	涛涛车业	209	9,747.76	0.00
62	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
63	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
64	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
65	600648	外高桥	800	9,048.00	0.00
66	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
67	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
68	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
69	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
70	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
71	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
72	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
73	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
74	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
75	002127	南极电商	2,000	7,660.00	0.00
76	300463	迈克生物	500	7,560.00	0.00
77	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
78	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
79	601065	江盐集团	547	6,476.48	0.00
80	601133	柏诚股份	482	5,909.32	0.00
81	002048	宁波华翔	372	4,984.80	0.00
82	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
83	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00

84	002242	九阳股份	241	3,602.95	0.00
85	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
86	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
87	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
88	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
89	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
90	002212	天融信	200	1,940.00	0.00
91	600216	浙江医药	100	1,095.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002463	沪电股份	2,302,091.60	0.41
2	000066	中国长城	2,091,689.00	0.37
3	600372	中航电子	1,859,881.87	0.33
4	000423	东阿阿胶	1,721,378.00	0.30
5	000933	神火股份	1,718,127.00	0.30
6	002240	盛新锂能	1,669,312.00	0.30
7	002008	大族激光	1,635,118.00	0.29
8	603882	金域医学	1,587,914.00	0.28
9	688169	石头科技	1,479,549.29	0.26
10	002600	领益智造	1,428,678.00	0.25
11	300395	菲利华	1,389,729.00	0.25
12	688536	思瑞浦	1,362,725.18	0.24
13	688220	翱捷科技-U	1,346,286.78	0.24
14	601966	玲珑轮胎	1,268,682.00	0.22
15	688072	拓荆科技	1,256,714.18	0.22
16	300118	东方日升	1,252,913.00	0.22
17	300487	蓝晓科技	1,226,390.00	0.22
18	300595	欧普康视	1,223,066.00	0.22
19	002432	九安医疗	1,205,213.00	0.21
20	300438	鹏辉能源	1,127,556.00	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	603345	安井食品	2,289,368.00	0.41
2	688122	西部超导	2,142,413.95	0.38
3	601607	上海医药	2,054,475.27	0.36
4	000999	华润三九	1,990,583.45	0.35

5	002603	以岭药业	1,893,161.60	0.34
6	603605	珀莱雅	1,843,852.80	0.33
7	601699	潞安环能	1,676,366.00	0.30
8	601872	招商轮船	1,664,515.00	0.29
9	603613	国联股份	1,594,180.00	0.28
10	688063	派能科技	1,529,420.15	0.27
11	300168	万达信息	1,480,994.00	0.26
12	600026	中远海能	1,465,804.88	0.26
13	603606	东方电缆	1,160,197.00	0.21
14	601333	广深铁路	1,078,005.00	0.19
15	002212	天融信	1,009,425.00	0.18
16	600201	生物股份	936,057.34	0.17
17	600728	佳都科技	871,583.00	0.15
18	002396	星网锐捷	795,681.00	0.14
19	688088	虹软科技	737,174.70	0.13
20	300376	易事特	682,853.00	0.12

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	85,857,175.70
卖出股票收入（成交）总额	99,263,053.41

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 7.11.2 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	20,092.69
2	应收清算款	1,188.19
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,591,660.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,612,941.38

### 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	301486	致尚科技	166,003.14	0.03	新股未上市
1	301486	致尚科技	18,451.20	0.00	新股流通受限

2	688582	芯动联科	17,085.60	0.00	新股流通受限
---	--------	------	-----------	------	--------

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	35,703	8,876.77	107,421,489.34	33.89	209,505,767.65	66.11
鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)	1,493	14,943.60	10,691,906.88	47.92	11,618,883.36	52.08
合计	37,196	9,120.28	118,113,396.22	34.82	221,124,651.01	65.18

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	赵建伟	428,372.00	7.74
2	施红梅	196,914.00	3.56
3	陈吉荃	150,042.00	2.71
4	张宇	133,500.00	2.41
5	鹿敏理	119,003.00	2.15
6	俞富良	117,026.00	2.12
7	于兆瑞	106,303.00	1.92
8	赵丽丽	100,017.00	1.81
9	余广述	100,015.00	1.81
10	张碧云	100,003.00	1.81

注：持有人为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	42,453.02	0.0134
	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)	132,254.94	0.5928

有本基金			
	合计	174,707.96	0.0515

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

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏华中证 500 指数 A 类 (LOF)	鹏华中证 500 指数 C 类 (LOF)
基金合同生效日 (2010 年 2 月 5 日) 基金份额总额	2,630,723,634.12	-
本报告期期初基金份额总额	316,116,501.17	29,897,162.22
本报告期基金总申购份额	24,882,574.68	22,056,065.06
减：本报告期基金总赎回份额	24,071,818.86	29,642,437.04
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	316,927,256.99	22,310,790.24

### § 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

#### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

#### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

#### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

##### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
银河证券	1	91,100,076.14	52.25	84,839.89	52.52	-
长江证券	1	83,256,362.15	47.75	76,703.41	47.48	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	本报告期新增

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

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 04 日
2	关于调整旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司申购、定期定额申购费率优惠活动时间公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 05 日
3	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2022 年第 4 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 01 月 20 日
4	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 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	2023 年 02 月 08 日

5	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (A 类基金份额) (LOF) 基金产品资料概要 (更新)	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 08 日
6	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (C 类基金份额) (LOF) 基金产品资料概要 (更新)	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 08 日
7	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购中润光学首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 02 月 10 日
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东方财富证券股份有限公司申购 (含定期定额投资) 费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 14 日
9	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2022 年年度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 03 月 30 日
10	鹏华基金管理有限公司关于新增人民币直销资金专户的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 07 日
11	鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2023 年第 1 季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 04 月 21 日
12	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购航天软件首次公开发行 A 股的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 17 日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 05 月 19 日
14	鹏华基金管理有限公司关于注意防范以协助办理贷款为借口进行诈骗活动的风险提示	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 03 日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国海证券股份有限公司申购 (含定期定额投资) 费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 05 日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 06 日
17	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京中植基金销售有限公司申购 (含定期定额投资) 费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 06 月 20 日
18	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分基金申购豪恩汽电首次公开发行 A 股	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会	2023 年 06 月 28 日

的公告	基金电子披露网站
-----	----------

注：无。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101~20230630	107,272,958.74	0.00	0.00	107,272,958.74	31.62
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额和红利再投资份额；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。
----

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- (二)《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- (三)《鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2023 年中期报告》(原文)。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

### 12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站 (<http://www.phfund.com.cn>) 查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日