

鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资  
基金  
2025 年中期报告

2025 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：华泰证券股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 28 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。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 年 01 月 01 日起至 2025 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>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<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	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	59

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 .....	59
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 .....	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
7.12 投资组合报告附注 .....	60
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
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 .....	62
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
10.4 基金投资策略的改变 .....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
10.8 其他重大事件 .....	64
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>65</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 .....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>65</b>
12.1 备查文件目录 .....	65
12.2 存放地点 .....	65
12.3 查阅方式 .....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	鹏华中证 800ETF
场内简称	中证 800ETF
基金主代码	159800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 6 月 27 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	华泰证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	38,736,802.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 7 月 12 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。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。
投资策略	<p>本基金采取完全复制策略，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票投资组合进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。</p> <p>本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年跟踪误差控制在 2% 以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>(1) 股票投资组合的构建</p> <p>本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金财产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p>(2) 股票投资组合的调整</p> <p>本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变</p>

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，以保证基金累计报酬率与标的指数同期累计报酬率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。

#### 1) 定期调整

根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。

#### 2) 不定期调整

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

根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；

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

#### 2、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。

本基金可投资可转换债券及可交换债券，可转换债券及可交换债券兼具债权和股权双重属性，本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和债券价值分析，结合本基金的产品定位和投资目标综合开展投资决策。

#### 4、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

#### 5、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>6、融资及转融通投资策略</p> <p>本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。</p> <p>为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。</p> <p>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、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。

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	华泰证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	刘强
	联系电话	0755-81395402	025-83387812
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	liuqiang023506@htsc.com
客户服务电话		4006788999	95597
传真		0755-82021126	025-83387215
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	江苏省南京市江东中路 228 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	江苏省南京市江东中路 228 号
邮政编码		518048	210009
法定代表人		张纳沙	张伟

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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(2025年1月1日-2025年6月30日)
本期已实现收益	4,521,303.74
本期利润	477,842.75
加权平均基金份额本期利润	0.0098
本期加权平均净值利润率	0.86%
本期基金份额净值增长率	1.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年6月30日)
期末可供分配利润	6,636,495.94
期末可供分配基金份额利润	0.1713
期末基金资产净值	45,373,297.94
期末基金份额净值	1.1713
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)
基金份额累计净值增长率	17.13%

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

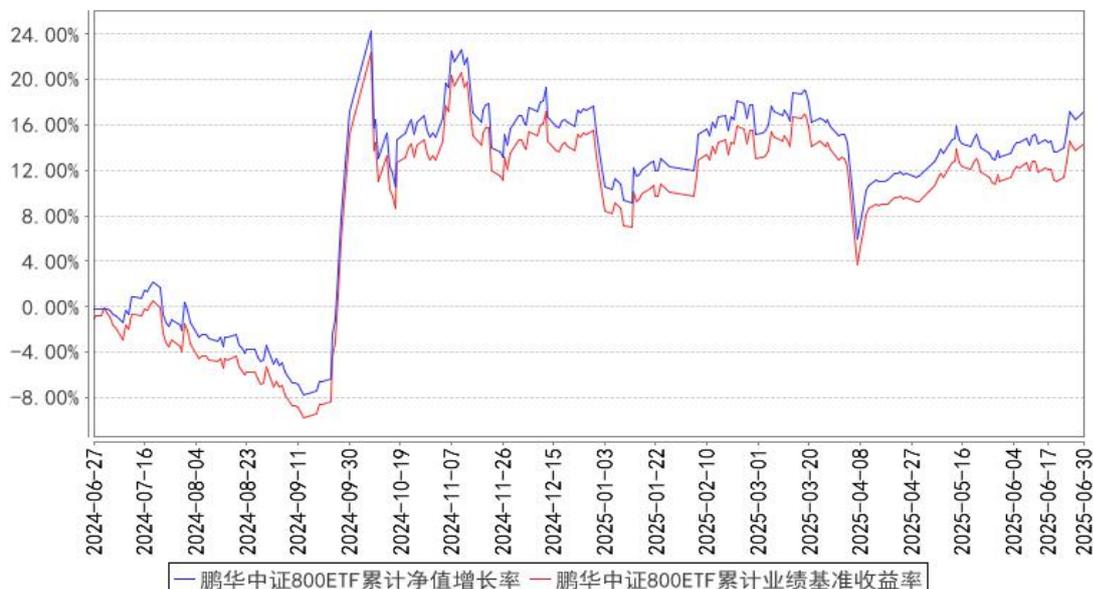
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.50%	0.59%	2.96%	0.62%	0.54%	-0.03%
过去三个月	1.83%	1.14%	1.18%	1.18%	0.65%	-0.04%
过去六个月	1.46%	1.06%	0.87%	1.09%	0.59%	-0.03%
过去一年	17.41%	1.42%	15.20%	1.45%	2.21%	-0.03%
自基金合同生效起至今	17.13%	1.41%	14.29%	1.44%	2.84%	-0.03%

注：业绩比较基准=中证 800 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

鹏华中证800ETF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 2024 年 06 月 27 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 12,513 亿元，359 只公募基金、12 只全国社保投资组合、8 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏俊杰	本基金的基金经理	2024-06-27	-	13 年	苏俊杰先生, 国籍中国, 理学硕士, 13 年证券从业经验。曾任 MSCI INC. 分析师, 华

				<p>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，现担任指数与量化投资部总经理/基金经理。2021 年 03 月至 2025 年 01 月担任鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理，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，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 2023 年 12 月担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，2022 年 08 月至 2023 年 08 月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 2023 年 08 月担任鹏华中证 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 月至今担任鹏华创业板 50 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，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，2023 年 06 月至今担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 08 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联接基金基金经理，2023 年 09 月至 2024 年 10 月担任鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 09 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2023 年 12 月至今担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金经理，2024 年 01 月至 2025 年 06 月担任鹏华智投 800 混合型证券投资基金基金经理，2024 年 05 月至今担任鹏华智投数字经济混合型证券投资基金基金经理，2024 年 06 月至今担任鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 02 月至今担任鹏华沪深 300 指数量化增强型证</p>
--	--	--	--	--

					券投资基金基金经理，2025 年 02 月至今担任鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华中证 A500 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。
--	--	--	--	--	---

注：1. 基金经理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：本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

### 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

A 股上半年震荡走高，在经历了年初由 deepseek 带动的春季躁动行情之后，二季度开始市场的主线围绕对等关税和稳增长政策展开。当市场受到对等关税的影响出现了比较剧烈的波动时候，我们仍然坚持认为从中长期来看，关税无碍中国制造业的全球竞争力，A 股当前的配置价值依然很高，包括海外资金在内的增量资金有望持续增配中国权益资产，从而推动市场的持续上行；事

后来看，A 股在二季度初经历短暂下挫后稳步震荡上行，在过程中市场情绪和赚钱效应也得以逐步修复。

展望下半年，随着风险偏好回暖，A 股下半年有望持续迎来增量资金入场，市场或延续结构性机会，不管是低估值高分红的价值型股票，还是市场空间大、渗透率低的成长类主题投资，都有可能成为资金关注的方向，配置上仍然推荐哑铃型的结构。

本基金一直以来秉承指数基金的投资策略，致力于通过精细化管理实现跟踪误差的最小化。在基金运作过程中，采用全复制法构建投资组合，即按照标的指数的成分股权重比例进行配置，以确保组合结构与指数的一致性。为应对日常申购赎回的需求，对组合进行适时的动态调整。同时建立了完善的组合再平衡机制，定期根据指数成分股调整和权重变化对投资组合进行优化。

#### 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 1.46%，同期业绩比较基准增长率为 0.87%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年下半年宏观经济预计仍然面临一系列挑战，一方面，美国对等关税政策对进出口贸易带来极大的不确定性，出口短期可能维持较高增速，但后期受关税上升影响易放缓；另一方面，国内有效需求仍然不足，价格仍然偏弱，需要重点关注政策的支持力度。预计政策会从需求和供给两个维度，双管齐下，通过反内卷出清行业过剩产能，提振价格，实现行业高质量发展，同时在需求端继续加力各类政策补贴、基建等。

市场走势上，在政策共识、盈利回升和资金回流共振驱动下，A 股可能在 2025 年下半年迎来真正行情拐点。美联储降息预期不断增强，全球流动性共振宽松，叠加中美关系缓和，将吸引外资回流；赚钱效应的改善，将推动股市作为居民资产配置的新蓄水池；此外机构的中长期配置资金也会继续有序的进入到市场中来。随着市场成熟度提升，未来市场的波动率有望实现系统性的降低，A 股市场可能会进入真正意义上的慢牛，长牛。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，由登记结算部、风控管理部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 6,636,495.94 元，期末基金份额净值 1.1713 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

本基金自 2025 年 03 月 21 日至 2025 年 06 月 11 日期间出现连续二十个（或以上）工作日基金资产净值低于五千万的情形。

## § 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

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、利润分配、费用开支等方面进行了复核，未发现基金管理人存在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

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金 2025 年中期报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等财务信息相关内容，相关内容真实、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 800 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,930,332.04	1,890,284.65
结算备付金		13,997.61	13,927.52
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	43,440,687.26	84,786,911.96
其中：股票投资		43,440,687.26	84,786,911.96
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,616.24	-
资产总计		45,460,633.15	86,691,124.13
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2024 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		-	29,305.30
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		19,745.99	40,240.47
应付托管费		3,949.20	8,048.10
应付销售服务费		-	-
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	63,640.02	327,111.43
负债合计		87,335.21	404,705.30
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	38,736,802.00	74,736,802.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	6,636,495.94	11,549,616.83
净资产合计		45,373,297.94	86,286,418.83
负债和净资产总计		45,460,633.15	86,691,124.13

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1713 元，基金份额总额 38,736,802.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 6 月 27 日(基金合 同生效日)至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		781,578.62	-1,396,965.36
1. 利息收入		7,094.32	39,433.99
其中：存款利息收入	6.4.7.13	7,094.32	39,433.99
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		4,748,869.63	16,400.65
其中：股票投资收益	6.4.7.14	4,176,771.57	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投 资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	572,098.06	16,400.65
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	-4,043,460.99	-1,452,962.00
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	69,075.66	162.00
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>303,735.87</b>	<b>31,028.82</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	139,468.07	24,155.67
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	27,893.60	4,831.14
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	136,374.20	2,042.01
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>477,842.75</b>	<b>-1,427,994.18</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>477,842.75</b>	<b>-1,427,994.18</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>477,842.75</b>	<b>-1,427,994.18</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	74,736,802.00	-	11,549,616.83	86,286,418.83
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	74,736,802.00	-	11,549,616.83	86,286,418.83
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-36,000,000.00	-	-4,913,120.89	-40,913,120.89
(一)、综合收益总额	-	-	477,842.75	477,842.75
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-36,000,000.00	-	-5,390,963.64	-41,390,963.64
其中：1. 基金申购款	16,000,000.00	-	2,224,735.94	18,224,735.94
2. 基金赎回款	-52,000,000.00	-	-7,615,699.58	-59,615,699.58
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	38,736,802.00	-	6,636,495.94	45,373,297.94
项目	上年度可比期间			
	2024年6月27日(基金合同生效日)至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	590,736,802.00	-	-	590,736,802.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-1,427,994.18	-1,427,994.18
(一)、综合收益总额	-	-	-1,427,994.18	-1,427,994.18

(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	590,736,802.00	-	-1,427,994.18	589,308,807.82

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

聂连杰

郝文高

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鹏华中证 800 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[2024]167 号《关于准予鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予,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 800 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 590,716,454.00 元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2400195 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 6 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 590,736,802.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 20,348.00 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公

司，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华中证800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2025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2025年06月30日的财务状况以及2025年上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

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

[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	606,169.98
等于：本金	605,854.63
加：应计利息	315.35

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	1,324,162.06
等于：本金	1,324,148.61
加：应计利息	13.45
减：坏账准备	-
合计	1,930,332.04

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	40,837,124.49	-	43,440,687.26	2,603,562.77
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	40,837,124.49	-	43,440,687.26	2,603,562.77

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

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

## 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025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	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	61,985.26
其他	1,654.76
合计	63,640.02

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	74,736,802.00	74,736,802.00
本期申购	16,000,000.00	16,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-52,000,000.00	-52,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	38,736,802.00	38,736,802.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

## 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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,312,513.48	-762,896.65	11,549,616.83
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	12,312,513.48	-762,896.65	11,549,616.83
本期利润	4,521,303.74	-4,043,460.99	477,842.75
本期基金份额交易产生	-6,893,453.82	1,502,490.18	-5,390,963.64

的变动数			
其中：基金申购款	3,808,595.41	-1,583,859.47	2,224,735.94
基金赎回款	-10,702,049.23	3,086,349.65	-7,615,699.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,940,363.40	-3,303,867.46	6,636,495.94

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
活期存款利息收入		6,750.14
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		274.09
结算备付金利息收入		70.09
其他		-
合计		7,094.32

注：1、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。

2、其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

#### 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	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		2,585,355.28
股票投资收益——赎回差价收入		1,591,416.29
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		4,176,771.57

##### 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	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
卖出股票成交总额		45,066,779.46
减：卖出股票成本总额		42,442,242.00
减：交易费用		39,182.18
买卖股票差价收入		2,585,355.28

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2025年1月1日至2025年6月30日	

赎回基金份额对价总额	59,615,699.58
减：现金支付赎回款总额	35,903,342.58
减：赎回股票成本总额	22,120,940.71
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,591,416.29

#### 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.14.5 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
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	572,098.06
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	572,098.06

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	-4,043,460.99
股票投资	-4,043,460.99
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	-4,043,460.99

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日

基金赎回费收入	-
替代损益	69,075.66
合计	69,075.66

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。

#### 6.4.7.22 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 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	12,396.69
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
登记结算费	74,383.76
存托服务费	5.18
IOPV 计算和发布费	9,916.99
合计	136,374.20

#### 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
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金托管人、基金的一级交易商
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
鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资	本基金的基金管理人管理的其他基金

基金发起式联接基金（“鹏华中证 800ETF 发起式联接”）
--------------------------------

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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年6月27日（基金合同生效日）至2024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（%）
华泰证券	64,604,518.10	100.00	-	-

##### 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 2025年1月1日至2025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	占期末应付佣金总量的比例（%）
华泰证券	12,659.14	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年6月27日（基金合同生效日）至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例（%）
华泰证券	-	-	-	-

注：1. 上述佣金按协议约定的佣金率计算，以扣除证管费、经手费等费用后的净额列示。佣金率由协议签订方参考市场价格确定。佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》相关要求。

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管

理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

#### 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 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年6月27日（基金合同生效日）至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	139,468.07	24,155.67
其中：应支付销售机构的客户维护费	48,410.75	11,394.38
应支付基金管理人的净管理费	91,057.32	12,761.29

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 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年6月27日（基金合同生效日）至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	27,893.60	4,831.14

注：支付基金托管人华泰证券的托管费按前一日基金资产净值0.10%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×0.10%/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

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自有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
华泰证券	5,639,647.00	14.56	12,677,661.00	16.96
鹏华中证 800ETF发起式 联接	8,321,804.00	21.48	-	-

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年6月27日(基金合同生效日)至2024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
华泰证券	1,930,332.04	7,024.23	545,430,796.22	36,047.42

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及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

2025年06月30日，本基金持有7,900.00股基金托管人华泰证券发行的A股普通股，账面价值为人民币140,699.00元，占基金资产净值的比例为0.31%；本基金持有4,500.00股国信证券发行的A股普通股，账面价值为人民币51,840.00元，占基金资产净值的比例为0.11%。(2024

年 06 月 30 日，本基金持有 72,700.00 股基金托管人华泰证券发行的 A 股普通股，账面价值为人民币 900,753.00 元，占基金资产净值的比例为 0.15%；本基金持有 3,800.00 股国信证券发行的 A 股普通股，账面价值为人民币 33,022.00 元，占基金资产净值的比例为 0.01%。）

#### 6.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 6.4.12 期末（2025 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

注：无。

##### 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

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

本基金为指数型基金。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法发行或上市交易的其他股票（包含主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、政府支持机构债、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可依据法律法规的规定，参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现基金净值增长率与标的指数增

长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行华泰证券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 2025 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2024 年 12 月 31 日：未持有）。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

于 2025 年 06 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要

求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,930,332.04	-	-	-	1,930,332.04
结算备付金	13,997.61	-	-	-	13,997.61
交易性金融资产	-	-	-	43,440,687.26	43,440,687.26
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	1,944,329.65	-	-	43,516,303.50	45,460,633.15
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	19,745.99	19,745.99
应付托管费	-	-	-	3,949.20	3,949.20
其他负债	-	-	-	63,640.02	63,640.02
负债总计	-	-	-	87,335.21	87,335.21
利率敏感度缺口	1,944,329.65	-	-	43,428,968.29	45,373,297.94
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	1,890,284.65	-	-	-	1,890,284.65
结算备付金	13,927.52	-	-	-	13,927.52
交易性金融资产	-	-	-	84,786,911.96	84,786,911.96
资产总计	1,904,212.17	-	-	84,786,911.96	86,691,124.13
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	40,240.47	40,240.47
应付托管费	-	-	-	8,048.10	8,048.10
应付清算款	-	-	-	29,305.30	29,305.30
其他负债	-	-	-	327,111.43	327,111.43
负债总计	-	-	-	404,705.30	404,705.30
利率敏感度缺口	1,904,212.17	-	-	84,382,206.66	86,286,418.83

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 2025 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

如果法律法规对该比例要求有变更的，可在履行适当程序后以变更后的比例为准。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 2025年6月30日		上年度末 2024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	43,440,687.26	95.74	84,786,911.96	98.26
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	43,440,687.26	95.74	84,786,911.96	98.26

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	2,202,419.88	-
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-2,202,419.88	-

	产净值变动		
--	-------	--	--

注：于 2024 年 12 月 31 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此，无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	43,440,687.26
第二层次	-
第三层次	-
合计	43,440,687.26

###### 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	43,440,687.26	95.56
	其中：股票	43,440,687.26	95.56
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	1,944,329.65	4.28
8	其他各项资产	75,616.24	0.17
9	合计	45,460,633.15	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 的合计项不含可退替代款估值增值。

2、报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：47,336.00 元，占净值比 0.10%。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	345,104.00	0.76
B	采矿业	2,021,347.96	4.45
C	制造业	23,245,130.80	51.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,528,615.00	3.37

E	建筑业	704,627.00	1.55
F	批发和零售业	328,255.00	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	1,326,247.00	2.92
H	住宿和餐饮业	29,838.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,548,114.88	5.62
J	金融业	9,769,745.66	21.53
K	房地产业	377,980.00	0.83
L	租赁和商务服务业	390,943.60	0.86
M	科学研究和技术服务业	426,909.00	0.94
N	水利、环境和公共设施管理业	46,700.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	23,256.00	0.05
Q	卫生和社会工作	141,267.36	0.31
R	文化、体育和娱乐业	159,857.00	0.35
S	综合	26,749.00	0.06
	合计	43,440,687.26	95.74

### 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

注：无。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	1,000	1,409,520.00	3.11
2	300750	宁德时代	4,100	1,034,102.00	2.28
3	601318	中国平安	16,600	920,968.00	2.03
4	600036	招商银行	19,100	877,645.00	1.93
5	601166	兴业银行	25,700	599,838.00	1.32
6	600900	长江电力	18,900	569,646.00	1.26
7	000333	美的集团	7,600	548,720.00	1.21
8	601899	紫金矿业	25,500	497,250.00	1.10
9	002594	比亚迪	1,400	464,674.00	1.02

10	300059	东方财富	19,600	453,348.00	1.00
11	600030	中信证券	15,100	417,062.00	0.92
12	601398	工商银行	54,200	411,378.00	0.91
13	600276	恒瑞医药	6,900	358,110.00	0.79
14	000858	五粮液	3,000	356,700.00	0.79
15	601211	国泰海通	17,436	334,073.76	0.74
16	601328	交通银行	41,200	329,600.00	0.73
17	000651	格力电器	6,900	309,948.00	0.68
18	601288	农业银行	49,400	290,472.00	0.64
19	600887	伊利股份	9,800	273,224.00	0.60
20	603259	药明康德	3,900	271,245.00	0.60
21	600919	江苏银行	22,700	271,038.00	0.60
22	002475	立讯精密	7,800	270,582.00	0.60
23	688981	中芯国际	3,000	264,510.00	0.58
24	601816	京沪高铁	45,400	261,050.00	0.58
25	600000	浦发银行	18,200	252,616.00	0.56
26	688256	寒武纪-U	378	227,367.00	0.50
27	000725	京东方 A	56,800	226,632.00	0.50
28	002371	北方华创	500	221,105.00	0.49
29	688041	海光信息	1,500	211,935.00	0.47
30	601088	中国神华	5,100	206,754.00	0.46
31	300308	中际旭创	1,400	204,204.00	0.45
32	300760	迈瑞医疗	900	202,275.00	0.45
33	300502	新易盛	1,580	200,691.60	0.44
34	601601	中国太保	5,300	198,803.00	0.44
35	300124	汇川技术	2,900	187,253.00	0.41
36	601728	中国电信	24,000	186,000.00	0.41
37	601668	中国建筑	32,000	184,640.00	0.41
38	600016	民生银行	38,400	182,400.00	0.40
39	000001	平安银行	15,000	181,050.00	0.40
40	002352	顺丰控股	3,700	180,412.00	0.40
41	002714	牧原股份	4,200	176,442.00	0.39
42	601127	赛力斯	1,300	174,616.00	0.38
43	002230	科大讯飞	3,600	172,368.00	0.38
44	603501	豪威集团	1,300	165,945.00	0.37
45	600031	三一重工	9,200	165,140.00	0.36
46	601229	上海银行	15,400	163,394.00	0.36
47	000063	中兴通讯	5,000	162,450.00	0.36
48	603019	中科曙光	2,300	161,920.00	0.36
49	002415	海康威视	5,700	158,061.00	0.35
50	600941	中国移动	1,400	157,570.00	0.35
51	600309	万华化学	2,900	157,354.00	0.35
52	601169	北京银行	22,900	156,407.00	0.34

53	601857	中国石油	17,500	149,625.00	0.33
54	300274	阳光电源	2,200	149,094.00	0.33
55	601919	中远海控	9,700	145,888.00	0.32
56	600690	海尔智家	5,800	143,724.00	0.32
57	600660	福耀玻璃	2,500	142,525.00	0.31
58	601012	隆基绿能	9,400	141,188.00	0.31
59	600809	山西汾酒	800	141,112.00	0.31
60	601688	华泰证券	7,900	140,699.00	0.31
61	300498	温氏股份	8,200	140,056.00	0.31
62	002142	宁波银行	5,100	139,536.00	0.31
63	688008	澜起科技	1,700	139,400.00	0.31
64	600406	国电南瑞	6,200	138,942.00	0.31
65	601766	中国中车	18,800	132,352.00	0.29
66	601138	工业富联	6,100	130,418.00	0.29
67	600050	中国联通	24,200	129,228.00	0.28
68	000338	潍柴动力	8,400	129,192.00	0.28
69	688012	中微公司	700	127,610.00	0.28
70	600028	中国石化	22,500	126,900.00	0.28
71	603986	兆易创新	1,000	126,530.00	0.28
72	000100	TCL 科技	29,000	125,570.00	0.28
73	601988	中国银行	22,200	124,764.00	0.27
74	000568	泸州老窖	1,100	124,740.00	0.27
75	601006	大秦铁路	18,700	123,420.00	0.27
76	300476	胜宏科技	900	120,942.00	0.27
77	600926	杭州银行	7,100	119,422.00	0.26
78	601818	光大银行	28,700	119,105.00	0.26
79	601985	中国核电	12,700	118,364.00	0.26
80	600104	上汽集团	7,200	115,560.00	0.25
81	601225	陕西煤业	6,000	115,440.00	0.25
82	002027	分众传媒	15,700	114,610.00	0.25
83	600150	中国船舶	3,500	113,890.00	0.25
84	601628	中国人寿	2,600	107,094.00	0.24
85	605499	东鹏饮料	340	106,777.00	0.24
86	601009	南京银行	9,100	105,742.00	0.23
87	688271	联影医疗	800	102,192.00	0.23
88	603288	海天味业	2,600	101,166.00	0.22
89	600999	招商证券	5,700	100,263.00	0.22
90	600436	片仔癀	500	100,005.00	0.22
91	600760	中航沈飞	1,700	99,654.00	0.22
92	000425	徐工机械	12,700	98,679.00	0.22
93	000625	长安汽车	7,700	98,252.00	0.22
94	601939	建设银行	10,400	98,176.00	0.22
95	000792	盐湖股份	5,700	97,356.00	0.21

96	600111	北方稀土	3,900	97,110.00	0.21
97	600938	中国海油	3,700	96,607.00	0.21
98	600905	三峡能源	22,100	94,146.00	0.21
99	600089	特变电工	7,800	93,054.00	0.21
100	601658	邮储银行	17,000	92,990.00	0.20
101	002050	三花智控	3,500	92,330.00	0.20
102	601888	中国中免	1,500	91,455.00	0.20
103	603993	洛阳钼业	10,800	90,936.00	0.20
104	600048	保利发展	11,100	89,910.00	0.20
105	300015	爱尔眼科	7,200	89,856.00	0.20
106	600547	山东黄金	2,812	89,787.16	0.20
107	600019	宝钢股份	13,600	89,624.00	0.20
108	002463	沪电股份	2,100	89,418.00	0.20
109	601390	中国中铁	15,900	89,199.00	0.20
110	002241	歌尔股份	3,800	88,616.00	0.20
111	300014	亿纬锂能	1,900	87,039.00	0.19
112	600415	小商品城	4,200	86,856.00	0.19
113	601825	沪农商行	8,900	86,330.00	0.19
114	601600	中国铝业	12,200	85,888.00	0.19
115	688111	金山办公	300	84,015.00	0.19
116	300033	同花顺	300	81,903.00	0.18
117	601989	中国重工	17,600	81,664.00	0.18
118	000977	浪潮信息	1,600	81,408.00	0.18
119	600893	航发动力	2,100	80,934.00	0.18
120	002179	中航光电	2,000	80,720.00	0.18
121	600585	海螺水泥	3,700	79,439.00	0.18
122	601916	浙商银行	23,300	78,987.00	0.17
123	600958	东方证券	8,100	78,408.00	0.17
124	601838	成都银行	3,900	78,390.00	0.17
125	000538	云南白药	1,400	78,106.00	0.17
126	603799	华友钴业	2,100	77,742.00	0.17
127	600015	华夏银行	9,800	77,518.00	0.17
128	000776	广发证券	4,600	77,326.00	0.17
129	600570	恒生电子	2,300	77,142.00	0.17
130	002311	海大集团	1,300	76,167.00	0.17
131	601336	新华保险	1,300	76,050.00	0.17
132	000988	华工科技	1,600	75,216.00	0.17
133	000938	紫光股份	3,100	74,369.00	0.16
134	600584	长电科技	2,200	74,118.00	0.16
135	002028	思源电气	1,000	72,910.00	0.16
136	002049	紫光国微	1,100	72,446.00	0.16
137	600438	通威股份	4,200	70,350.00	0.16
138	000166	申万宏源	14,000	70,280.00	0.15

139	300408	三环集团	2,100	70,140.00	0.15
140	601998	中信银行	8,200	69,700.00	0.15
141	300433	蓝思科技	3,100	69,130.00	0.15
142	601077	渝农商行	9,600	68,544.00	0.15
143	000002	万科 A	10,500	67,410.00	0.15
144	600795	国电电力	13,800	66,792.00	0.15
145	601377	兴业证券	10,700	66,233.00	0.15
146	600489	中金黄金	4,500	65,835.00	0.15
147	601669	中国电建	13,300	64,771.00	0.14
148	600988	赤峰黄金	2,600	64,688.00	0.14
149	601995	中金公司	1,800	63,648.00	0.14
150	600010	包钢股份	35,100	62,829.00	0.14
151	601689	拓普集团	1,300	61,425.00	0.14
152	002422	科伦药业	1,700	61,064.00	0.13
153	300339	润和软件	1,200	60,996.00	0.13
154	002966	苏州银行	6,900	60,582.00	0.13
155	600009	上海机场	1,900	60,363.00	0.13
156	600160	巨化股份	2,100	60,228.00	0.13
157	000768	中航西飞	2,200	60,148.00	0.13
158	300394	天孚通信	740	59,081.60	0.13
159	688036	传音控股	733	58,420.10	0.13
160	601881	中国银河	3,400	58,310.00	0.13
161	002304	洋河股份	900	58,095.00	0.13
162	601100	恒立液压	800	57,600.00	0.13
163	002460	赣锋锂业	1,700	57,409.00	0.13
164	600183	生益科技	1,900	57,285.00	0.13
165	601186	中国铁建	7,100	56,871.00	0.13
166	000963	华东医药	1,400	56,504.00	0.12
167	002252	上海莱士	8,200	56,334.00	0.12
168	000157	中联重科	7,700	55,671.00	0.12
169	600839	四川长虹	5,700	55,404.00	0.12
170	002074	国轩高科	1,700	55,182.00	0.12
171	601360	三六零	5,400	55,080.00	0.12
172	600989	宝丰能源	3,400	54,876.00	0.12
173	600886	国投电力	3,700	54,538.00	0.12
174	300442	润泽科技	1,100	54,483.00	0.12
175	601788	光大证券	3,000	53,940.00	0.12
176	601058	赛轮轮胎	4,100	53,792.00	0.12
177	601555	东吴证券	6,100	53,375.00	0.12
178	600115	中国东航	13,200	53,196.00	0.12
179	601162	天风证券	10,700	52,751.00	0.12
180	600066	宇通客车	2,100	52,206.00	0.12
181	002736	国信证券	4,500	51,840.00	0.11

182	002466	天齐锂业	1,600	51,264.00	0.11
183	000408	藏格矿业	1,200	51,204.00	0.11
184	000807	云铝股份	3,200	51,136.00	0.11
185	002001	新和成	2,400	51,048.00	0.11
186	601901	方正证券	6,400	50,624.00	0.11
187	002517	恺英网络	2,600	50,206.00	0.11
188	600196	复星医药	2,000	50,180.00	0.11
189	002340	格林美	7,900	50,165.00	0.11
190	600426	华鲁恒升	2,300	49,841.00	0.11
191	000661	长春高新	500	49,590.00	0.11
192	002195	岩山科技	8,800	49,544.00	0.11
193	002261	拓维信息	1,600	49,520.00	0.11
194	002558	巨人网络	2,100	49,455.00	0.11
195	000975	山金国际	2,600	49,244.00	0.11
196	002236	大华股份	3,100	49,228.00	0.11
197	301236	软通动力	900	49,176.00	0.11
198	001979	招商蛇口	5,600	49,112.00	0.11
199	600029	南方航空	8,300	48,970.00	0.11
200	601800	中国交建	5,500	48,895.00	0.11
201	002156	通富微电	1,900	48,678.00	0.11
202	600011	华能国际	6,800	48,552.00	0.11
203	688521	芯原股份	500	48,250.00	0.11
204	600674	川投能源	3,000	48,120.00	0.11
205	601066	中信建投	2,000	48,100.00	0.11
206	600487	亨通光电	3,100	47,430.00	0.10
207	689009	九号公司-WD	800	47,336.00	0.10
208	300418	昆仑万维	1,400	47,082.00	0.10
209	600346	恒力石化	3,300	47,058.00	0.10
210	688126	沪硅产业	2,500	46,800.00	0.10
211	603369	今世缘	1,200	46,716.00	0.10
212	300251	光线传媒	2,300	46,621.00	0.10
213	300661	圣邦股份	637	46,354.49	0.10
214	300207	欣旺达	2,300	46,138.00	0.10
215	002797	第一创业	6,500	46,020.00	0.10
216	600157	永泰能源	34,300	45,962.00	0.10
217	601878	浙商证券	4,200	45,822.00	0.10
218	601111	中国国航	5,800	45,762.00	0.10
219	603893	瑞芯微	300	45,558.00	0.10
220	002916	深南电路	420	45,280.20	0.10
221	002648	卫星化学	2,600	45,058.00	0.10
222	688777	中控技术	1,000	44,910.00	0.10
223	600460	士兰微	1,800	44,676.00	0.10
224	600372	中航机载	3,700	44,622.00	0.10

225	601868	中国能建	20,000	44,600.00	0.10
226	601021	春秋航空	800	44,520.00	0.10
227	003816	中国广核	12,200	44,408.00	0.10
228	000066	中国长城	3,000	44,400.00	0.10
229	302132	中航成飞	500	43,970.00	0.10
230	600096	云天化	2,000	43,940.00	0.10
231	002273	水晶光电	2,200	43,934.00	0.10
232	688169	石头科技	280	43,834.00	0.10
233	601117	中国化学	5,700	43,719.00	0.10
234	603129	春风动力	200	43,300.00	0.10
235	601168	西部矿业	2,600	43,238.00	0.10
236	002465	海格通信	3,100	43,214.00	0.10
237	600879	航天电子	4,100	42,927.00	0.09
238	300782	卓胜微	600	42,822.00	0.09
239	600588	用友网络	3,200	42,784.00	0.09
240	601319	中国人保	4,900	42,679.00	0.09
241	300347	泰格医药	800	42,656.00	0.09
242	002294	信立泰	900	42,597.00	0.09
243	000786	北新建材	1,600	42,368.00	0.09
244	600741	华域汽车	2,400	42,360.00	0.09
245	300803	指南针	525	42,346.50	0.09
246	300450	先导智能	1,700	42,245.00	0.09
247	600176	中国巨石	3,700	42,180.00	0.09
248	002601	龙佰集团	2,600	42,146.00	0.09
249	600536	中国软件	900	42,093.00	0.09
250	600600	青岛啤酒	600	41,676.00	0.09
251	600219	南山铝业	10,800	41,364.00	0.09
252	601099	太平洋	10,500	41,265.00	0.09
253	688213	思特威-W	400	40,888.00	0.09
254	002920	德赛西威	400	40,852.00	0.09
255	601633	长城汽车	1,900	40,812.00	0.09
256	300017	网宿科技	3,800	40,736.00	0.09
257	600352	浙江龙盛	4,000	40,640.00	0.09
258	002185	华天科技	4,000	40,400.00	0.09
259	603296	华勤技术	500	40,340.00	0.09
260	600885	宏发股份	1,800	40,158.00	0.09
261	688047	龙芯中科	300	40,017.00	0.09
262	000596	古井贡酒	300	39,945.00	0.09
263	000933	神火股份	2,400	39,936.00	0.09
264	000630	铜陵有色	11,900	39,746.00	0.09
265	000831	中国稀土	1,100	39,732.00	0.09
266	600085	同仁堂	1,100	39,666.00	0.09
267	600039	四川路桥	4,000	39,600.00	0.09

268	601108	财通证券	5,000	39,550.00	0.09
269	002281	光迅科技	800	39,456.00	0.09
270	600482	中国动力	1,700	39,219.00	0.09
271	000895	双汇发展	1,600	39,056.00	0.09
272	002493	荣盛石化	4,700	38,916.00	0.09
273	601877	正泰电器	1,700	38,539.00	0.08
274	001965	招商公路	3,200	38,400.00	0.08
275	002129	TCL 中环	5,000	38,400.00	0.08
276	002130	沃尔核材	1,600	38,112.00	0.08
277	002709	天赐材料	2,100	38,052.00	0.08
278	600079	人福医药	1,800	37,764.00	0.08
279	601128	常熟银行	5,120	37,734.40	0.08
280	688396	华润微	800	37,728.00	0.08
281	300454	深信服	400	37,672.00	0.08
282	600362	江西铜业	1,600	37,488.00	0.08
283	301269	华大九天	300	37,164.00	0.08
284	002600	领益智造	4,300	36,937.00	0.08
285	603596	伯特利	700	36,883.00	0.08
286	601577	长沙银行	3,700	36,778.00	0.08
287	688469	芯联集成-U	7,700	36,729.00	0.08
288	000423	东阿阿胶	700	36,610.00	0.08
289	603392	万泰生物	600	36,600.00	0.08
290	002085	万丰奥威	2,300	36,547.00	0.08
291	300474	景嘉微	500	36,500.00	0.08
292	688122	西部超导	700	36,316.00	0.08
293	300058	蓝色光标	5,460	35,817.60	0.08
294	002532	天山铝业	4,300	35,733.00	0.08
295	300458	全志科技	900	35,721.00	0.08
296	000997	新大陆	1,100	35,618.00	0.08
297	002595	豪迈科技	600	35,532.00	0.08
298	300002	神州泰岳	3,000	35,400.00	0.08
299	002738	中矿资源	1,100	35,376.00	0.08
300	000783	长江证券	5,100	35,343.00	0.08
301	300122	智飞生物	1,800	35,262.00	0.08
302	002938	鹏鼎控股	1,100	35,233.00	0.08
303	002851	麦格米特	700	35,098.00	0.08
304	600109	国金证券	4,000	35,080.00	0.08
305	002353	杰瑞股份	1,000	35,000.00	0.08
306	600363	联创光电	600	34,998.00	0.08
307	002078	太阳纸业	2,600	34,996.00	0.08
308	300896	爱美客	200	34,962.00	0.08
309	688052	纳芯微	200	34,898.00	0.08
310	002410	广联达	2,600	34,866.00	0.08

311	688002	睿创微纳	500	34,860.00	0.08
312	300346	南大光电	1,100	34,804.00	0.08
313	600233	圆通速递	2,700	34,803.00	0.08
314	601933	永辉超市	7,100	34,790.00	0.08
315	688099	晶晨股份	488	34,652.88	0.08
316	300223	北京君正	500	34,600.00	0.08
317	600161	天坛生物	1,800	34,542.00	0.08
318	002436	兴森科技	2,600	34,424.00	0.08
319	300857	协创数据	400	34,424.00	0.08
320	300054	鼎龙股份	1,200	34,416.00	0.08
321	002180	纳思达	1,500	34,410.00	0.08
322	300759	康龙化成	1,400	34,356.00	0.08
323	300496	中科创达	600	34,332.00	0.08
324	000301	东方盛虹	4,100	34,153.00	0.08
325	688220	翱捷科技-U	435	34,060.50	0.08
326	300832	新产业	600	34,032.00	0.08
327	002850	科达利	300	33,951.00	0.07
328	600862	中航高科	1,300	33,904.00	0.07
329	000034	神州数码	900	33,876.00	0.07
330	002138	顺络电子	1,200	33,744.00	0.07
331	688120	华海清科	200	33,740.00	0.07
332	688361	中科飞测	400	33,676.00	0.07
333	002065	东华软件	3,500	33,600.00	0.07
334	300136	信维通信	1,500	33,600.00	0.07
335	002472	双环传动	1,000	33,490.00	0.07
336	000999	华润三九	1,070	33,469.60	0.07
337	601198	东兴证券	3,000	33,450.00	0.07
338	600188	兖矿能源	2,740	33,345.80	0.07
339	600580	卧龙电驱	1,680	33,213.60	0.07
340	600873	梅花生物	3,100	33,139.00	0.07
341	603605	珀莱雅	400	33,116.00	0.07
342	600143	金发科技	3,200	32,992.00	0.07
343	603087	甘李药业	600	32,868.00	0.07
344	600023	浙能电力	6,200	32,860.00	0.07
345	000876	新希望	3,500	32,830.00	0.07
346	002202	金风科技	3,200	32,800.00	0.07
347	601618	中国中冶	11,000	32,780.00	0.07
348	300024	机器人	1,900	32,642.00	0.07
349	000728	国元证券	4,100	32,349.00	0.07
350	002673	西部证券	4,100	32,308.00	0.07
351	601615	明阳智能	2,800	32,172.00	0.07
352	300115	长盈精密	1,500	32,100.00	0.07
353	002223	鱼跃医疗	900	32,040.00	0.07

354	000021	深科技	1,700	31,858.00	0.07
355	002624	完美世界	2,100	31,857.00	0.07
356	600875	东方电气	1,900	31,806.00	0.07
357	002008	大族激光	1,300	31,681.00	0.07
358	688223	晶科能源	6,100	31,659.00	0.07
359	600298	安琪酵母	900	31,653.00	0.07
360	600515	海南机场	8,900	31,506.00	0.07
361	300383	光环新网	2,200	31,460.00	0.07
362	300604	长川科技	700	31,437.00	0.07
363	600549	厦门钨业	1,500	31,380.00	0.07
364	601872	招商轮船	5,000	31,300.00	0.07
365	603606	东方电缆	600	31,026.00	0.07
366	300765	新诺威	600	31,014.00	0.07
367	002459	晶澳科技	3,100	30,938.00	0.07
368	600895	张江高科	1,200	30,840.00	0.07
369	600171	上海贝岭	900	30,825.00	0.07
370	688072	拓荆科技	200	30,742.00	0.07
371	600845	宝信软件	1,300	30,706.00	0.07
372	300395	菲利华	600	30,660.00	0.07
373	601898	中煤能源	2,800	30,632.00	0.07
374	688599	天合光能	2,100	30,513.00	0.07
375	300012	华测检测	2,600	30,394.00	0.07
376	603659	璞泰来	1,600	30,048.00	0.07
377	000733	振华科技	600	30,030.00	0.07
378	000426	兴业银锡	1,900	30,020.00	0.07
379	300757	罗博特科	200	29,994.00	0.07
380	002155	湖南黄金	1,680	29,988.00	0.07
381	605117	德业股份	560	29,489.60	0.06
382	300627	华测导航	840	29,400.00	0.06
383	600061	国投资本	3,900	29,328.00	0.06
384	600332	白云山	1,100	28,996.00	0.06
385	600027	华电国际	5,300	28,991.00	0.06
386	600392	盛和资源	2,200	28,974.00	0.06
387	300003	乐普医疗	2,100	28,938.00	0.06
388	688180	君实生物-U	850	28,883.00	0.06
389	601216	君正集团	5,200	28,704.00	0.06
390	300699	光威复材	900	28,503.00	0.06
391	000617	中油资本	3,900	28,470.00	0.06
392	000519	中兵红箭	1,300	28,457.00	0.06
393	000729	燕京啤酒	2,200	28,446.00	0.06
394	601665	齐鲁银行	4,500	28,440.00	0.06
395	603260	合盛硅业	600	28,440.00	0.06
396	000750	国海证券	6,900	28,428.00	0.06

397	603160	汇顶科技	400	28,412.00	0.06
398	688065	凯赛生物	600	28,260.00	0.06
399	601717	郑煤机	1,700	28,254.00	0.06
400	000932	华菱钢铁	6,400	28,160.00	0.06
401	000983	山西焦煤	4,400	28,160.00	0.06
402	300037	新宙邦	800	28,160.00	0.06
403	601997	贵阳银行	4,500	28,080.00	0.06
404	002444	巨星科技	1,100	28,061.00	0.06
405	600153	建发股份	2,700	27,999.00	0.06
406	000878	云南铜业	2,200	27,984.00	0.06
407	688578	艾力斯	300	27,912.00	0.06
408	603979	金诚信	600	27,864.00	0.06
409	300628	亿联网络	800	27,808.00	0.06
410	601696	中银证券	2,600	27,794.00	0.06
411	605589	圣泉集团	1,000	27,750.00	0.06
412	600918	中泰证券	4,300	27,649.00	0.06
413	002837	英维克	930	27,630.30	0.06
414	600060	海信视像	1,200	27,624.00	0.06
415	601233	桐昆股份	2,600	27,560.00	0.06
416	300142	沃森生物	2,500	27,500.00	0.06
417	601990	南京证券	3,400	27,472.00	0.06
418	300316	晶盛机电	1,000	27,150.00	0.06
419	000893	亚钾国际	900	27,126.00	0.06
420	600369	西南证券	6,200	26,970.00	0.06
421	688525	佰维存储	400	26,960.00	0.06
422	688582	芯动联科	400	26,880.00	0.06
423	600673	东阳光	2,300	26,749.00	0.06
424	600025	华能水电	2,800	26,740.00	0.06
425	002414	高德红外	2,600	26,650.00	0.06
426	002007	华兰生物	1,700	26,639.00	0.06
427	601698	中国卫通	1,300	26,611.00	0.06
428	300999	金龙鱼	900	26,577.00	0.06
429	002821	凯莱英	300	26,475.00	0.06
430	600803	新奥股份	1,400	26,460.00	0.06
431	600316	洪都航空	700	26,390.00	0.06
432	300001	特锐德	1,100	26,367.00	0.06
433	688249	晶合集成	1,300	26,351.00	0.06
434	300073	当升科技	600	26,322.00	0.06
435	600177	雅戈尔	3,600	26,280.00	0.06
436	300748	金力永磁	1,100	26,224.00	0.06
437	300413	芒果超媒	1,200	26,184.00	0.06
438	600699	均胜电子	1,500	26,160.00	0.06
439	600521	华海药业	1,400	26,082.00	0.06

440	300373	扬杰科技	500	25,950.00	0.06
441	688114	华大智造	400	25,932.00	0.06
442	600398	海澜之家	3,700	25,752.00	0.06
443	002318	久立特材	1,100	25,729.00	0.06
444	600118	中国卫星	900	25,713.00	0.06
445	600909	华安证券	4,400	25,652.00	0.06
446	601059	信达证券	1,500	25,650.00	0.06
447	002152	广电运通	1,900	25,536.00	0.06
448	601238	广汽集团	3,400	25,466.00	0.06
449	000623	吉林敖东	1,500	25,425.00	0.06
450	600765	中航重机	1,500	25,320.00	0.06
451	600704	物产中大	4,800	25,296.00	0.06
452	600562	国睿科技	800	25,192.00	0.06
453	603228	景旺电子	600	25,104.00	0.06
454	601799	星宇股份	200	25,000.00	0.06
455	688017	绿的谐波	200	24,978.00	0.06
456	600435	北方导航	1,600	24,944.00	0.05
457	000738	航发控制	1,200	24,900.00	0.05
458	000009	中国宝安	2,800	24,864.00	0.05
459	600497	驰宏锌锗	4,700	24,863.00	0.05
460	001696	宗申动力	1,100	24,695.00	0.05
461	002044	美年健康	4,800	24,672.00	0.05
462	600141	兴发集团	1,200	24,636.00	0.05
463	688385	复旦微电	500	24,635.00	0.05
464	600018	上港集团	4,300	24,553.00	0.05
465	002958	青农商行	6,800	24,548.00	0.05
466	603345	安井食品	300	24,126.00	0.05
467	000528	柳工	2,500	24,025.00	0.05
468	000400	许继电气	1,100	23,947.00	0.05
469	300623	捷捷微电	800	23,840.00	0.05
470	002683	广东宏大	700	23,758.00	0.05
471	600155	华创云信	3,400	23,664.00	0.05
472	600884	杉杉股份	2,500	23,650.00	0.05
473	603179	新泉股份	500	23,485.00	0.05
474	603486	科沃斯	400	23,292.00	0.05
475	600038	中直股份	600	23,286.00	0.05
476	002607	中公教育	7,600	23,256.00	0.05
477	601607	上海医药	1,300	23,244.00	0.05
478	600486	扬农化工	400	23,200.00	0.05
479	300558	贝达药业	400	23,180.00	0.05
480	600637	东方明珠	3,100	23,157.00	0.05
481	600498	烽火通信	1,100	23,133.00	0.05
482	300919	中伟股份	700	23,016.00	0.05

483	300763	锦浪科技	400	22,956.00	0.05
484	000960	锡业股份	1,500	22,950.00	0.05
485	688082	盛美上海	200	22,788.00	0.05
486	300679	电连技术	500	22,690.00	0.05
487	000415	渤海租赁	6,700	22,311.00	0.05
488	600529	山东药玻	1,000	22,140.00	0.05
489	600132	重庆啤酒	400	22,040.00	0.05
490	603939	益丰药房	900	22,023.00	0.05
491	000039	中集集团	2,800	22,008.00	0.05
492	002409	雅克科技	400	21,876.00	0.05
493	301358	湖南裕能	700	21,833.00	0.05
494	600563	法拉电子	200	21,818.00	0.05
495	600901	江苏金租	3,600	21,816.00	0.05
496	300724	捷佳伟创	400	21,720.00	0.05
497	002739	万达电影	1,900	21,717.00	0.05
498	600026	中远海能	2,100	21,693.00	0.05
499	688278	特宝生物	300	21,633.00	0.05
500	000513	丽珠集团	600	21,624.00	0.05
501	688568	中科星图	600	21,606.00	0.05
502	002926	华西证券	2,400	21,456.00	0.05
503	002385	大北农	5,300	21,412.00	0.05
504	688297	中无人机	400	21,360.00	0.05
505	002653	海思科	500	21,110.00	0.05
506	000887	中鼎股份	1,200	21,108.00	0.05
507	688303	大全能源	986	21,021.52	0.05
508	002939	长城证券	2,500	20,950.00	0.05
509	603589	口子窖	600	20,880.00	0.05
510	300285	国瓷材料	1,200	20,820.00	0.05
511	002841	视源股份	600	20,760.00	0.05
512	600820	隧道股份	3,400	20,740.00	0.05
513	000723	美锦能源	4,800	20,736.00	0.05
514	603806	福斯特	1,600	20,736.00	0.05
515	002312	川发龙蟒	1,800	20,664.00	0.05
516	002025	航天电器	400	20,564.00	0.05
517	688009	中国通号	4,000	20,560.00	0.05
518	600863	内蒙华电	5,000	20,550.00	0.05
519	600008	首创环保	6,800	20,536.00	0.05
520	300144	宋城演艺	2,400	20,520.00	0.05
521	002064	华峰化学	3,100	20,491.00	0.05
522	002568	百润股份	800	20,488.00	0.05
523	688183	生益电子	400	20,480.00	0.05
524	603816	顾家家居	800	20,416.00	0.04
525	600390	五矿资本	3,500	20,405.00	0.04

526	603195	公牛集团	420	20,265.00	0.04
527	688472	阿特斯	2,200	20,130.00	0.04
528	688538	和辉光电-U	8,600	20,124.00	0.04
529	300487	蓝晓科技	400	20,120.00	0.04
530	600166	福田汽车	7,400	20,054.00	0.04
531	600998	九州通	3,900	20,046.00	0.04
532	688728	格科微	1,300	20,020.00	0.04
533	000703	恒逸石化	3,400	19,992.00	0.04
534	600516	方大炭素	4,300	19,952.00	0.04
535	300676	华大基因	400	19,908.00	0.04
536	601179	中国西电	3,200	19,648.00	0.04
537	002203	海亮股份	1,900	19,608.00	0.04
538	600170	上海建工	8,200	19,598.00	0.04
539	002080	中材科技	1,000	19,500.00	0.04
540	600021	上海电力	2,200	19,338.00	0.04
541	600985	淮北矿业	1,700	19,278.00	0.04
542	002500	山西证券	3,300	19,272.00	0.04
543	603379	三美股份	400	19,248.00	0.04
544	600208	衢州发展	6,500	19,240.00	0.04
545	000683	博源化工	4,000	19,160.00	0.04
546	601155	新城控股	1,400	19,152.00	0.04
547	600583	海油工程	3,500	19,110.00	0.04
548	603568	伟明环保	1,000	19,080.00	0.04
549	600763	通策医疗	462	19,071.36	0.04
550	600872	中炬高新	1,000	19,000.00	0.04
551	601699	潞安环能	1,800	18,990.00	0.04
552	603338	浙江鼎力	400	18,960.00	0.04
553	600126	杭钢股份	2,100	18,900.00	0.04
554	603885	吉祥航空	1,400	18,858.00	0.04
555	000403	派林生物	1,040	18,855.20	0.04
556	000708	中信特钢	1,600	18,816.00	0.04
557	600535	天士力	1,200	18,780.00	0.04
558	600380	健康元	1,700	18,751.00	0.04
559	002262	恩华药业	900	18,702.00	0.04
560	601000	唐山港	4,600	18,676.00	0.04
561	600348	华阳股份	2,800	18,648.00	0.04
562	605358	立昂微	800	18,640.00	0.04
563	601236	红塔证券	2,200	18,634.00	0.04
564	000830	鲁西化工	1,800	18,540.00	0.04
565	002244	滨江集团	1,900	18,525.00	0.04
566	600312	平高电气	1,200	18,468.00	0.04
567	000591	太阳能	4,200	18,438.00	0.04
568	000629	钒钛股份	7,200	18,432.00	0.04

569	601991	大唐发电	5,800	18,386.00	0.04
570	002603	以岭药业	1,300	18,330.00	0.04
571	000060	中金岭南	4,000	18,320.00	0.04
572	601865	福莱特	1,200	18,252.00	0.04
573	002432	九安医疗	500	18,215.00	0.04
574	603000	人民网	900	18,189.00	0.04
575	300567	精测电子	300	18,183.00	0.04
576	301536	星宸科技	300	18,090.00	0.04
577	600095	湘财股份	1,800	18,054.00	0.04
578	000921	海信家电	700	17,990.00	0.04
579	300146	汤臣倍健	1,600	17,984.00	0.04
580	000636	风华高科	1,300	17,862.00	0.04
581	600816	建元信托	6,000	17,700.00	0.04
582	600499	科达制造	1,800	17,640.00	0.04
583	002439	启明星辰	1,100	17,589.00	0.04
584	688234	天岳先进	300	17,565.00	0.04
585	301308	江波龙	200	17,498.00	0.04
586	600511	国药股份	600	17,496.00	0.04
587	601611	中国核建	1,900	17,461.00	0.04
588	300212	易华录	800	17,408.00	0.04
589	603927	中科软	900	17,406.00	0.04
590	601880	辽港股份	11,600	17,400.00	0.04
591	603899	晨光股份	600	17,394.00	0.04
592	002773	康弘药业	600	17,382.00	0.04
593	601016	节能风电	6,000	17,340.00	0.04
594	603728	鸣志电器	300	17,241.00	0.04
595	600970	中材国际	2,000	17,160.00	0.04
596	002423	中粮资本	1,400	17,122.00	0.04
597	000958	电投产融	2,500	17,100.00	0.04
598	601666	平煤股份	2,300	17,043.00	0.04
599	002056	横店东磁	1,200	16,980.00	0.04
600	603077	和邦生物	9,700	16,975.00	0.04
601	603737	三棵树	460	16,951.00	0.04
602	603833	欧派家居	300	16,935.00	0.04
603	603156	养元饮品	800	16,928.00	0.04
604	002984	森麒麟	900	16,875.00	0.04
605	000563	陕国投 A	4,700	16,779.00	0.04
606	603298	杭叉集团	800	16,760.00	0.04
607	000155	川能动力	1,700	16,694.00	0.04
608	600859	王府井	1,200	16,668.00	0.04
609	600655	豫园股份	3,000	16,650.00	0.04
610	002507	涪陵榨菜	1,300	16,627.00	0.04
611	000598	兴蓉环境	2,300	16,583.00	0.04

612	300677	英科医疗	700	16,576.00	0.04
613	601456	国联民生	1,600	16,560.00	0.04
614	600325	华发股份	3,400	16,558.00	0.04
615	300888	稳健医疗	400	16,440.00	0.04
616	601958	金钼股份	1,500	16,410.00	0.04
617	300390	天华新能	860	16,400.20	0.04
618	600483	福能股份	1,700	16,388.00	0.04
619	600004	白云机场	1,800	16,380.00	0.04
620	688778	厦钨新能	292	16,328.64	0.04
621	600685	中船防务	600	16,314.00	0.04
622	603290	斯达半导	200	16,254.00	0.04
623	603341	龙旗科技	400	16,252.00	0.04
624	600378	昊华科技	600	16,242.00	0.04
625	000050	深天马 A	1,900	16,188.00	0.04
626	601966	玲珑轮胎	1,100	16,137.00	0.04
627	000062	深圳华强	600	16,116.00	0.04
628	600737	中粮糖业	1,700	16,065.00	0.04
629	003031	中瓷电子	300	15,963.00	0.04
630	600282	南钢股份	3,800	15,960.00	0.04
631	600663	陆家嘴	1,800	15,948.00	0.04
632	600131	国网信通	900	15,930.00	0.04
633	601136	首创证券	800	15,904.00	0.04
634	601001	晋控煤业	1,300	15,886.00	0.04
635	002756	永兴材料	500	15,875.00	0.03
636	600598	北大荒	1,100	15,862.00	0.03
637	000951	中国重汽	900	15,822.00	0.03
638	600566	济川药业	600	15,798.00	0.03
639	000987	越秀资本	2,300	15,778.00	0.03
640	688772	珠海冠宇	1,100	15,719.00	0.03
641	600271	航天信息	1,700	15,708.00	0.03
642	600754	锦江酒店	700	15,708.00	0.03
643	600582	天地科技	2,600	15,574.00	0.03
644	002430	杭氧股份	800	15,536.00	0.03
645	601918	新集能源	2,400	15,504.00	0.03
646	002120	韵达股份	2,300	15,410.00	0.03
647	600739	辽宁成大	1,400	15,400.00	0.03
648	002429	兆驰股份	3,500	15,330.00	0.03
649	601866	中远海发	6,200	15,314.00	0.03
650	000559	万向钱潮	2,000	15,300.00	0.03
651	300070	碧水源	3,400	15,300.00	0.03
652	300601	康泰生物	1,000	15,190.00	0.03
653	300529	健帆生物	700	15,099.00	0.03
654	300735	光弘科技	600	15,060.00	0.03

655	601333	广深铁路	5,200	15,028.00	0.03
656	600867	通化东宝	1,800	14,760.00	0.03
657	600995	南网储能	1,500	14,670.00	0.03
658	601231	环旭电子	1,000	14,630.00	0.03
659	603858	步长制药	900	14,616.00	0.03
660	300573	兴齐眼药	280	14,501.20	0.03
661	601098	中南传媒	1,100	14,432.00	0.03
662	600707	彩虹股份	2,200	14,212.00	0.03
663	000032	深桑达 A	700	14,161.00	0.03
664	600258	首旅酒店	1,000	14,130.00	0.03
665	603688	石英股份	400	14,088.00	0.03
666	601212	白银有色	4,500	14,085.00	0.03
667	002831	裕同科技	600	14,052.00	0.03
668	000709	河钢股份	6,500	14,040.00	0.03
669	000027	深圳能源	2,200	14,036.00	0.03
670	600578	京能电力	3,100	13,919.00	0.03
671	300751	迈为股份	200	13,912.00	0.03
672	000967	盈峰环境	2,000	13,900.00	0.03
673	600517	国网英大	2,700	13,770.00	0.03
674	603529	爱玛科技	400	13,760.00	0.03
675	600906	财达证券	2,000	13,640.00	0.03
676	600848	上海临港	1,500	13,605.00	0.03
677	600764	中国海防	400	13,600.00	0.03
678	688561	奇安信-U	400	13,592.00	0.03
679	002670	国盛金控	900	13,545.00	0.03
680	000883	湖北能源	3,000	13,530.00	0.03
681	600959	江苏有线	3,900	13,416.00	0.03
682	601928	凤凰传媒	1,200	13,404.00	0.03
683	688676	金盘科技	400	13,380.00	0.03
684	600329	达仁堂	400	13,344.00	0.03
685	002508	老板电器	700	13,307.00	0.03
686	300957	贝泰妮	300	13,266.00	0.03
687	601399	国机重装	4,400	13,200.00	0.03
688	600546	山煤国际	1,500	13,095.00	0.03
689	601156	东航物流	1,000	13,090.00	0.03
690	600968	海油发展	3,200	13,056.00	0.03
691	600977	中国电影	1,200	12,864.00	0.03
692	002299	圣农发展	900	12,861.00	0.03
693	603650	彤程新材	400	12,860.00	0.03
694	688187	时代电气	300	12,795.00	0.03
695	603225	新凤鸣	1,200	12,780.00	0.03
696	600808	马钢股份	3,700	12,765.00	0.03
697	601118	海南橡胶	2,700	12,744.00	0.03

698	002572	索菲亚	900	12,609.00	0.03
699	000739	普洛药业	900	12,600.00	0.03
700	000825	太钢不锈	3,500	12,565.00	0.03
701	600528	中铁工业	1,700	12,546.00	0.03
702	601636	旗滨集团	2,500	12,525.00	0.03
703	603565	中谷物流	1,300	12,415.00	0.03
704	600056	中国医药	1,200	12,408.00	0.03
705	601808	中海油服	900	12,384.00	0.03
706	601598	中国外运	2,500	12,325.00	0.03
707	002266	浙富控股	4,000	12,320.00	0.03
708	600871	石化油服	6,300	12,285.00	0.03
709	600377	宁沪高速	800	12,272.00	0.03
710	601608	中信重工	2,800	12,236.00	0.03
711	300595	欧普康视	800	12,216.00	0.03
712	301301	川宁生物	1,000	12,040.00	0.03
713	601106	中国一重	4,300	12,040.00	0.03
714	688375	国博电子	200	12,002.00	0.03
715	688520	神州细胞	200	11,970.00	0.03
716	000543	皖能电力	1,700	11,900.00	0.03
717	000785	居然智家	3,900	11,895.00	0.03
718	688387	信科移动-U	2,100	11,865.00	0.03
719	600801	华新水泥	1,000	11,840.00	0.03
720	000582	北部湾港	1,400	11,550.00	0.03
721	603233	大参林	700	11,410.00	0.03
722	688563	航材股份	200	11,326.00	0.02
723	600373	中文传媒	1,100	11,297.00	0.02
724	002153	石基信息	1,300	11,258.00	0.02
725	603658	安图生物	300	11,250.00	0.02
726	600062	华润双鹤	600	11,196.00	0.02
727	600925	苏能股份	2,100	10,983.00	0.02
728	301498	乖宝宠物	100	10,937.00	0.02
729	000537	中绿电	1,300	10,868.00	0.02
730	000429	粤高速 A	800	10,664.00	0.02
731	601965	中国汽研	600	10,650.00	0.02
732	300979	华利集团	200	10,514.00	0.02
733	600606	绿地控股	6,400	10,432.00	0.02
734	688363	华熙生物	203	10,424.05	0.02
735	002372	伟星新材	1,000	10,360.00	0.02
736	000800	一汽解放	1,500	10,290.00	0.02
737	688425	铁建重工	2,500	10,200.00	0.02
738	600098	广州发展	1,600	10,000.00	0.02
739	600361	创新新材	2,500	9,975.00	0.02
740	601568	北元集团	2,400	9,960.00	0.02

741	600612	老凤祥	200	9,950.00	0.02
742	000937	冀中能源	1,700	9,775.00	0.02
743	001286	陕西能源	1,100	9,570.00	0.02
744	003022	联泓新科	600	9,498.00	0.02
745	601019	山东出版	1,000	9,470.00	0.02
746	688248	南网科技	300	9,438.00	0.02
747	001391	国货航	1,400	9,422.00	0.02
748	600688	上海石化	3,300	9,405.00	0.02
749	603707	健友股份	800	8,920.00	0.02
750	601139	深圳燃气	1,400	8,904.00	0.02
751	600339	中油工程	2,700	8,829.00	0.02
752	002608	江苏国信	1,200	8,796.00	0.02
753	301165	锐捷网络	140	8,604.40	0.02
754	000898	鞍钢股份	3,700	8,584.00	0.02
755	600720	中交设计	1,100	8,503.00	0.02
756	000959	首钢股份	2,500	8,500.00	0.02
757	600032	浙江新能	1,100	8,316.00	0.02
758	003035	南网能源	1,800	8,262.00	0.02
759	600928	西安银行	2,100	8,232.00	0.02
760	002461	珠江啤酒	700	7,903.00	0.02
761	688172	燕东微	400	7,864.00	0.02
762	600295	鄂尔多斯	900	7,839.00	0.02
763	301267	华夏眼科	400	7,668.00	0.02
764	603556	海兴电力	300	7,641.00	0.02
765	688349	三一重能	300	7,482.00	0.02
766	601228	广州港	2,300	7,429.00	0.02
767	002563	森马服饰	1,300	6,838.00	0.02
768	601061	中信金属	800	6,328.00	0.01
769	688475	萤石网络	200	6,304.00	0.01
770	688153	唯捷创芯	200	6,202.00	0.01
771	600007	中国国贸	300	6,174.00	0.01
772	300140	节能环保	1,000	6,170.00	0.01
773	600927	永安期货	400	5,924.00	0.01
774	000539	粤电力 A	1,300	5,902.00	0.01
775	001389	广合科技	100	5,877.00	0.01
776	603826	坤彩科技	300	5,871.00	0.01
777	600299	安迪苏	600	5,790.00	0.01
778	002945	华林证券	400	5,748.00	0.01
779	001213	中铁特货	1,400	5,684.00	0.01
780	601921	浙版传媒	700	5,642.00	0.01
781	688819	天能股份	200	5,552.00	0.01
782	603786	科博达	100	5,541.00	0.01
783	601158	重庆水务	900	4,176.00	0.01

784	688295	中复神鹰	200	4,160.00	0.01
785	601858	中国科传	200	3,890.00	0.01
786	600956	新天绿能	500	3,860.00	0.01
787	603868	飞科电器	100	3,587.00	0.01
788	001289	龙源电力	200	3,236.00	0.01

**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**  
注：无。

#### 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	601211	国泰海通	678,245.68	0.79
2	600519	贵州茅台	622,952.00	0.72
3	601318	中国平安	475,323.00	0.55
4	600036	招商银行	449,526.00	0.52
5	601166	兴业银行	344,107.00	0.40
6	600900	长江电力	278,514.00	0.32
7	002371	北方华创	255,446.00	0.30
8	601899	紫金矿业	252,128.00	0.29
9	002594	比亚迪	241,098.00	0.28
10	300750	宁德时代	207,491.00	0.24
11	600030	中信证券	207,297.00	0.24
12	600276	恒瑞医药	204,824.00	0.24
13	600436	片仔癀	204,048.00	0.24
14	601398	工商银行	202,306.00	0.23
15	688041	海光信息	195,976.00	0.23
16	601328	交通银行	184,205.00	0.21
17	600941	中国移动	167,667.00	0.19
18	601288	农业银行	142,901.00	0.17
19	600887	伊利股份	142,228.00	0.16
20	601816	京沪高铁	138,043.00	0.16

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	600519	贵州茅台	1,923,002.00	2.23
2	601318	中国平安	1,299,423.00	1.51
3	600036	招商银行	1,228,827.00	1.42
4	600900	长江电力	797,063.00	0.92
5	601166	兴业银行	720,614.00	0.84
6	601899	紫金矿业	668,940.00	0.78

7	600030	中信证券	608,225.00	0.70
8	601211	国泰海通	592,397.00	0.69
9	601398	工商银行	560,449.00	0.65
10	600276	恒瑞医药	506,621.00	0.59
11	688981	中芯国际	424,806.00	0.49
12	600887	伊利股份	405,645.00	0.47
13	601328	交通银行	402,112.00	0.47
14	601288	农业银行	387,807.00	0.45
15	601816	京沪高铁	387,443.00	0.45
16	688041	海光信息	373,454.88	0.43
17	600919	江苏银行	339,783.00	0.39
18	601988	中国银行	336,841.00	0.39
19	603259	药明康德	330,663.00	0.38
20	600837	海通证券(退市)	326,573.68	0.38

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	20,154,098.00
卖出股票收入（成交）总额	45,066,779.46

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回

回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

### 7.11.2 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

兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	75,616.24

### 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

注：无。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
927	41,787.27	18,682,646.00	48.23	20,054,156.00	51.77

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
华泰证券股份有限公司-鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	8,321,804.00	21.48

### 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	华泰证券股份有限公司	5,639,647.00	14.56
2	广发证券股份有限公司	2,644,495.00	6.83
3	格尔木健桥医院有限公司	1,262,700.00	3.26
4	LI ZHEN	751,692.00	1.94
5	长江金色共富企业年金集合计划-上海浦东发展银行股份有限公司	499,100.00	1.29
6	陈小琳	439,795.00	1.14
7	陈健伟	353,136.00	0.91
8	王晓明	300,007.00	0.77
9	王洪力	300,005.00	0.77
10	方咸如	250,004.00	0.65
-	华泰证券股份有限公司-鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基	8,321,804.00	21.48

	金		
--	---	--	--

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024年6月27日） 基金份额总额	590,736,802.00
本报告期期初基金份额总额	74,736,802.00
本报告期基金总申购份额	16,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	52,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	38,736,802.00

## § 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：

无。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

无。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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 (%)	
华泰证券	6	64,604,518.10	100.00	12,659.14	100.00	-

注：交易单元选择的标准和程序：

1. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称《规定》），基金管理人制定了相应的管理制度规范交易单元选择的标准和程序。基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券公司，选择标准包括：财务状况良好，经营行为规范；有完备的合规管理流程和制度，风险控制能力较强；研究、交易等服务能力较强，交易设施能够为投资组合提供有效的交易执行；中国证监会或有权机关规定的其他条件等。

2. 选择程序如下：

- (1) 基金管理人根据上述标准评估并确定选用的证券公司；
- (2) 基金管理人与提供证券交易服务的证券公司签订协议，并办理开立交易账户等事宜；
- (3) 基金管理人定期对证券公司进行评价，依据评价结果选择交易单元。

3. 根据《规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率；其他类型基金股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。

4. 国泰海通会商并获得上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所、全国中小企业股份转让系统、中国结算、各签约存管银行及基金管理公司等相关单位的协同支持，拟定于 2025 年 9 月 12 日的日终清算后，于上述单位实施法人切换、客户及业务迁移合并，将原海通证券的客

户及业务迁移合并入国泰海通。截止本报告期末，原租用海通证券、国泰君安的交易单元未完成迁移合并，故本表列示的海通证券、国泰君安数据包含本基金在本报告期内通过原交易单元交易的情况。

### 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(%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-

### 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	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 21 日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加财通证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 22 日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加开源证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 28 日
4	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 28 日
5	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 31 日
6	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	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 12 日
7	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 04 月 21 日
8	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 05 月 09 日
9	鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 05 月 09 日

注：无。

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20250620~20250630	0.00	8,321,804.00	0.00	8,321,804.00	21.48
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 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2025 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

2025 年 8 月 28 日