

鹏华中证 500 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	14
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	60
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	60
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末上市基金前十名持有人	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	63
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证 500
场内简称	中证 500ETF 鹏华
基金主代码	159982
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 11 月 21 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	194,211,253.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 2 月 20 日

2.2 基金产品说明

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

	率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对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。 (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。 2、债券投资策略 本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。 3、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。 4、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。 5、参与融资及转融通证券出借业务策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。 为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、
--	--

	期限和比例。 本基金将密切跟踪国内关于基金参与融券业务法律法规的实施进展，待允许本基金参与融券业务的相关规定颁布后，将在届时相应法律法规的框架内，参与融券业务。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 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		张纳沙	廖林

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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	12,288,783.57

本期利润	18,862,046.74
加权平均基金份额本期利润	0.0888
本期加权平均净值利润率	6.05%
本期基金份额净值增长率	5.31%
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	102,125,588.78
期末可供分配基金份额利润	0.5258
期末基金资产净值	296,784,105.27
期末基金份额净值	1.5282
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	52.82%

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。

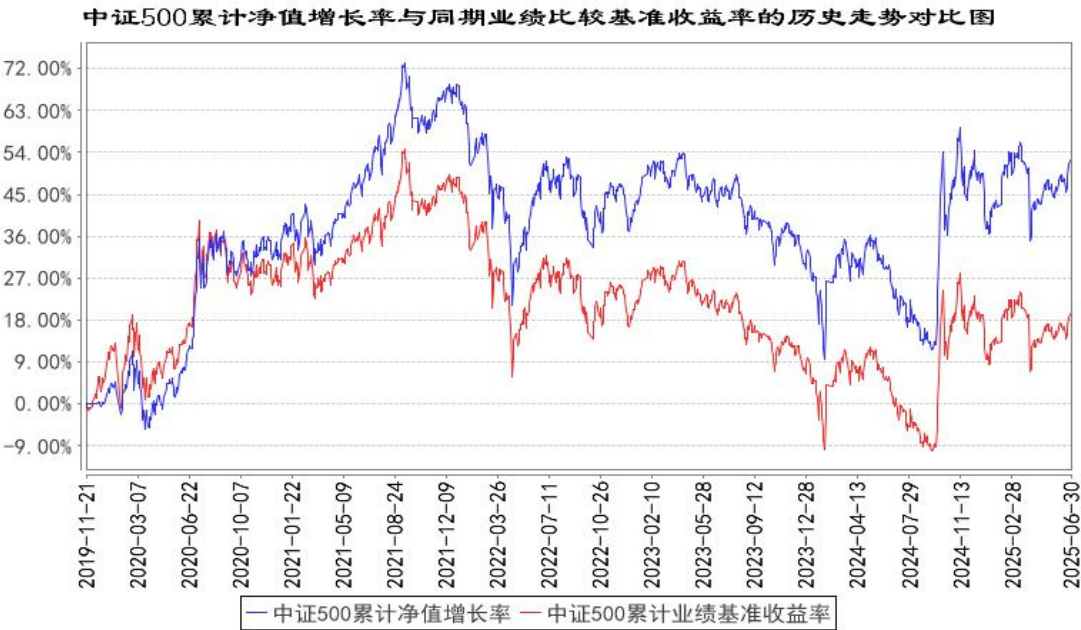
3.2 基金净值表现

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	5.11%	0.78%	4.31%	0.79%	0.80%	-0.01%
过去三个月	2.29%	1.50%	0.98%	1.50%	1.31%	0.00%
过去六个月	5.31%	1.35%	3.31%	1.36%	2.00%	-0.01%
过去一年	24.20%	1.70%	19.68%	1.72%	4.52%	-0.02%
过去三年	1.43%	1.33%	-8.35%	1.35%	9.78%	-0.02%
自基金合同生效起至今	52.82%	1.31%	19.59%	1.36%	33.23%	-0.05%

注：业绩比较基准=中证 500 指数收益率。

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



注：1、本基金基金合同于 2019 年 11 月 21 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		
陈龙	本基金的基金经理	2019-11-21	-	16 年	陈龙先生, 国籍中国, 经济学硕士, 16 年证券从业经验。曾任杭州衡泰软件公司金融

				工程师，2009 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部金融工程总监助理、量化及衍生品投资部量化研究总监助理，先后从事金融工程、量化研究等工作，现担任指数与量化投资部副总经理、基金经理。2015 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 07 月至 2018 年 04 月担任鹏华创业板指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 04 月担任鹏华中证 800 地产指数分级证券投资基金基金经理，2016 年 09 月至 2018 年 05 月担任鹏华港股通中证香港中小企业投资主题指数证券投资基金（LOF）基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 04 月担任鹏华中证移动互联网指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证 800 证券保险指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证国防指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至 2020 年 12 月担任鹏华中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理，2019 年 03 月至今担任鹏华中证空天一体军工指数证券投资基金（LOF）基金经理，2019 年 11 月至今担任鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2019 年 12 月至 2022 年 10 月担任鹏华国证证券龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 01 月至今担任鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2021 年 01 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证 800 证券保险指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2021 年 01 月至 2022 年 10 月担任鹏华中证全指证券公司指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2021 年 01 月至今担任鹏华中证国防指数型证券投资基金（LOF）基金经理，2021 年 02 月至今担任鹏华中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2022 年 08 月至今担任鹏华中证国防交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 02 月至 2025 年 03 月担任鹏华国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2023 年 07 月至今担任鹏华国证粮
--	--	--	--	--

					食产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2024 年 09 月至今担任鹏华国证粮食产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2025 年 03 月至今担任鹏华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，陈龙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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配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

本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数，中证 500 指数是在中证全指样本空间内，剔除沪深 300 指数成分股及最近一年日均总市值排名在前 300 名的股票之后，并剔除样本空间剩余股票最近一年日均成交金额后 20%的股票，选取最近一年日均总市值排名前 500 名的股票，以综合反映 A 股市场中小市值公司的整体情况。

上半年，中证 500 指数上涨 3.31%，同期上证指数上涨 2.76%，沪深 300 指数上涨 0.03%。节奏上，年初市场经历了短暂的调整，随后在 DeepSeek 等带动下，走出了一轮春季躁动行情；4 月初受美国对等关税冲击，大盘出现了系统性的调整，随后维稳资金入场，带动市场触底回升，并逐步收复 4 月初的调整，上证指数在 6 月底创出了年内新高。结构方面，市场呈现出非常明显的哑铃特征，大市值中的银行以及小微盘等表现相对强势，今年以来获得显著的超额收益。

本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人通过对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。

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 5.31%，同期业绩比较基准增长率为 3.31%。

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 年上半年，市场整体还是呈现宽幅震荡。年初市场经历了短暂的调整，随后在 DeepSeek 与宇树科技等带动下，走出了一轮春季躁动行情，AI 算力、机器人等方向领涨；4 月初受美国对等关税冲击，大盘出现了系统性的调整，随后维稳资金入场，带动市场触底回升，并逐步收复 4 月初的调整，上证指数在 6 月底创出了年内新高。

宏观方面，量、价背离的趋势仍然在延续，上半年 GDP 增速 5.3%，但 CPI、PPI 等数据仍然表现低迷，使得市场参与主体的体感仍然偏弱。在需求端，外需虽有关税扰动，但仍然表现出了较强的韧性；而内需主要依托于“以旧换新”政策对社零的支撑，而房地产投资和价格等仍然延续下滑的趋势。最终反映到上市公司层面上，盈利依然偏弱，景气赛道依然匮乏。

在此背景下，以保险资金为代表的配置资金进一步缩圈至银行，而高净值客户则借道量化私募参与小微盘，活跃资金则在一些偏主题方向快速轮动，如 AI 算力、机器人、创新药、国防军工、固态电池、可控核聚变等。

展望下半年，整体上我们认为 A 股还是延续慢牛的格局，同时牛市的积极因素已经在逐步积累。我们相对更看好四季度，一方面是宏观经济的压力有望在四季度显现，从而倒逼增量政策的落地，其次中美的贸易谈判在四季度可能会更加明朗，从而进一步提振市场的风险偏好。

基本面的维度，受制于对等关税的影响，今年企业整体盈利水平还是一个寻底的过程，乐观情形下，明年有望迎来企业盈利的拐点。从 1-2 年的视角看，如果不考虑外部关系的极端恶化，在低利率的刺激下，我们应该能够看到一轮由“盈利修复”和“存款搬家”共同驱动的牛市行情。

结构方面，1-2 个季度视角，银行等红利资产依然可以作为底仓配置，但是性价比会有所下降，

建议重视低位的科技 AI，以及二季度以来调整相对比较充分的机器人板块。国防军工板块虽然上半年已经有所表现，但是我们认为下半年依然还有进一步表现的机会，具体来看：1）“十四五”收官及“十五五”规划引领行业走出新一轮景气周期，而中报有望首次验证本轮景气反转；2）军贸带动军工资产价值重估，后续有望从主题演绎转向订单驱动；3）阅兵活动相对明确的时间节点，有望凝聚资金的共识，推动板块走出一轮主升浪。

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 102,125,588.78 元，期末基金份额净值 1.5282 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 2025 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 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
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	10,045,421.40	15,043,437.17
结算备付金		5,097,122.58	3,735,285.22
存出保证金		1,678,949.65	2,141,807.03
交易性金融资产	6.4.7.2	280,731,442.89	319,249,728.76
其中：股票投资		280,731,442.89	319,249,728.76
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		67,063.41	295,213.21
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		297,619,999.93	340,465,471.39
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		227,114.11	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		36,522.42	46,180.87
应付托管费		12,174.13	15,393.64
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	36,203.19
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	560,084.00	484,260.14
负债合计		835,894.66	582,037.84
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	194,211,253.00	234,211,253.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	102,572,852.27	105,672,180.55
净资产合计		296,784,105.27	339,883,433.55
负债和净资产总计		297,619,999.93	340,465,471.39

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.5282 元，基金份额总额 194,211,253.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		19,273,376.81	-52,268,059.27
1. 利息收入		28,448.16	545,483.29
其中：存款利息收入	6.4.7.13	28,448.16	93,262.91
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		-	10,645.89
其他利息收入		-	441,574.49
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		12,418,805.23	-61,004,579.33
其中：股票投资收益	6.4.7.14	9,449,348.84	-65,912,797.25
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	161,570.95	-935,894.88
股利收益	6.4.7.19	2,807,885.44	5,844,112.80
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	6,573,263.17	7,538,063.88
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	252,860.25	652,972.89
减：二、营业总支出		411,330.07	901,774.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	232,421.21	532,856.62
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	77,473.75	177,618.82
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		2,774.45	1,590.50
8. 其他费用	6.4.7.23	98,660.66	189,708.23

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,862,046.74	-53,169,833.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,862,046.74	-53,169,833.44
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		18,862,046.74	-53,169,833.44

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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	234,211,253.00	-	105,672,180.55	339,883,433.55
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	234,211,253.00	-	105,672,180.55	339,883,433.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-40,000,000.00	-	-3,099,328.28	-43,099,328.28
（一）、综合收益总额	-	-	18,862,046.74	18,862,046.74
（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）	-40,000,000.00	-	-21,961,375.02	-61,961,375.02
其中：1. 基金申购款	40,000,000.00	-	17,112,150.47	57,112,150.47
2. 基金赎回款	-80,000,000.00	-	-39,073,525.49	-119,073,525.49
（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	194,211,253.00	-	102,572,852.27	296,784,105.27
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 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	1,020,211,253.00	-	337,273,132.92	1,357,484,385.92
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,020,211,253.00	-	337,273,132.92	1,357,484,385.92
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-674,000,000.00	-	-257,505,019.46	-931,505,019.46
(一)、综合收益总额	-	-	-53,169,833.44	-53,169,833.44
(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)	-674,000,000.00	-	-204,335,186.02	-878,335,186.02
其中：1. 基金申购款	40,000,000.00	-	9,675,035.69	49,675,035.69
2. 基金赎回款	-714,000,000.00	-	-214,010,221.71	-928,010,221.71
(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	346,211,253.00	-	79,768,113.46	425,979,366.46

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

基金管理人负责人

聂连杰

主管会计工作负责人

郝文高

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]第 1504 号《关于准予鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 490,173,730.00 元(含募集股票市值)，经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0669 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 11 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 490,211,253.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 37,523.00 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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	10,045,421.40
等于：本金	10,044,563.52
加：应计利息	857.88
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	10,045,421.40

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		266,343,753.53	-	280,731,442.89	14,387,689.36
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		266,343,753.53	-	280,731,442.89	14,387,689.36

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

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	13,077,600.00	-	-	-
其中：股指期货投资	13,077,600.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	13,077,600.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2512	IC2512	12.00	13,573,440.00	495,840.00
合计				495,840.00
减：可抵销期货				495,840.00

暂收款				
净额				0.00

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
----	-----

	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	20,278.22
其中：交易所市场	20,278.22
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	76,814.59
应退替代款	462,991.19
合计	560,084.00

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	234,211,253.00	234,211,253.00
本期申购	40,000,000.00	40,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-80,000,000.00	-80,000,000.00
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	194,211,253.00	194,211,253.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

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	109,362,986.19	-3,690,805.64	105,672,180.55
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	109,362,986.19	-3,690,805.64	105,672,180.55
本期利润	12,288,783.57	6,573,263.17	18,862,046.74
本期基金份额交易产生的变动数	-19,526,180.98	-2,435,194.04	-21,961,375.02
其中：基金申购款	19,605,782.18	-2,493,631.71	17,112,150.47

基金赎回款	-39,131,963.16	58,437.67	-39,073,525.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	102,125,588.78	447,263.49	102,572,852.27

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	21,059.58
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	7,242.58
其他	146.00
合计	28,448.16

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 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	5,851,861.72
股票投资收益——赎回差价收入	3,597,487.12
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	9,449,348.84

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	98,583,294.15
减：卖出股票成本总额	92,637,939.67
减：交易费用	93,492.76
买卖股票差价收入	5,851,861.72

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	119,073,525.49
减：现金支付赎回款总额	62,612,232.49
减：赎回股票成本总额	52,863,805.88

减：交易费用	-
赎回差价收入	3, 597, 487. 12

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

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	161,570.95

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	2,807,885.44
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	2,807,885.44

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	5,634,623.17
股票投资	5,634,623.17
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	938,640.00
权证投资	-
期货投资	938,640.00
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	6,573,263.17

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	252,860.25
合计	252,860.25

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	17,307.22
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	279.00
指数使用费	21,462.13
存托服务费	104.94
合计	98,660.66

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人

国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金的一级交易商
鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“鹏华中证 500ETF 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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 1 月 1 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（%）
国信证券	39,037,841.64	22.08	467,684,477.40	71.11

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 总额的比例（%）
国信证券	7,259.51	22.08	5,862.13	28.91
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 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 总额的比例（%）
国信证券	428,263.39	71.76	155,516.35	60.07

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 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	232,421.21	532,856.62
其中：应支付销售机构的客户维护费	37,201.72	6,977.97
应支付基金管理人的净管理费	195,219.49	525,878.65

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 0.15%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

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

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 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	77,473.75	177,618.82

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 0.05%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×0.05%/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

单位：人民币元

本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间（%）	加权平均费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国信证券	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间（%）	加权平均费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国信证券	3,859,471.00	2.00~3.10	2.33	3,669.85	-	-

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

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（%）
鹏华中证 500ETF 联接	45,084,637.00	23.21	50,542,037.00	21.58

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 1 月 1 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
中国工商银行	10,045,421.40	21,059.58	11,561,313.91	32,933.29

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	603325	博隆技术	网下申购	660	47,823.60

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（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

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
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新股流通受限	5.30	14.44	673	3,566.90	9,718.12	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通	2025 年 6 月	1 个月内（含）	新股未上	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-

	电子	24 日		市						
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001395	亚联机械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股流通受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	27.50	56.19	279	7,672.50	15,677.01	-
301458	钧崴电子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通受限	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	弘景光电于 2025 年 5 月 28 日每 10 股送 4 股
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股流通受限	39.92	45.22	244	6,706.56	11,033.68	恒鑫生活于 2025 年 6 月 6 日每 10 股送 4.5 股
301535	浙江华远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301560	众捷	2025 年 4 月	6 个月	新股流通	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-

	汽车	17 日		受限						
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	64	5,734.40	8,926.72	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股流通受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	140	3,710.00	4,575.20	-
603072	天和磁	2024 年 12 月 24	6 个月	新股流通受限	12.30	54.45	192	2,361.60	10,454.40	-

	材	日								
603120	肯特催化	2025 年4月 9日	6个月	新股 流通 受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025 年3月 12日	6个月	新股 流通 受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025 年4月 16日	6个月	新股 流通 受限	93.50	90.66	42	3,927.00	3,807.72	-
603210	泰鸿万立	2025 年4月 1日	6个月	新股 流通 受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025 年3月 28日	6个月	新股 流通 受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025 年3月 4日	6个月	新股 流通 受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603382	海阳科技	2025 年6月 5日	6个月	新股 流通 受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025 年6月 12日	6个月	新股 流通 受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025 年2月 25日	6个月	新股 流通 受限	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025 年1月 20日	6个月	新股 流通 受限	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025 年1月 15日	6个月	新股 流通 受限	11.68	26.95	758	8,853.44	20,428.10	-
688583	思	2025	6个月	新股	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	思看科

	看科技	年1月8日		流通受限						技于2025年6月19日每10股送3股
688755	汉邦科技	2025年5月9日	6个月	新股流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	胜科纳米	2025年3月18日	6个月	新股流通受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025年1月2日	6个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025年6月4日	6个月	新股流通受限	47.27	124.16	216	10,210.32	26,818.56	-

注：1、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中需要限售的部分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。

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、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

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
400174	中天3	2023年08月30日	重大事项	0.00	-	-	286,500	500,813.56	0.00	-

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（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的股票、存托凭证）、债券（含国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具、同业存单、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同责任，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 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约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	10,045,421.40	-	-	-	10,045,421.40
结算备付金	5,097,122.58	-	-	-	5,097,122.58
存出保证金	1,678,949.65	-	-	-	1,678,949.65
交易性金融资产	-	-	-	-280,731,442.89	280,731,442.89
应收清算款	-	-	-	67,063.41	67,063.41
资产总计	16,821,493.63	-	-	-280,798,506.30	297,619,999.93
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	36,522.42	36,522.42
应付托管费	-	-	-	12,174.13	12,174.13
应付清算款	-	-	-	227,114.11	227,114.11
其他负债	-	-	-	560,084.00	560,084.00
负债总计	-	-	-	835,894.66	835,894.66
利率敏感度缺口	16,821,493.63	-	-	-279,962,611.64	296,784,105.27
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	15,043,437.17	-	-	-	15,043,437.17
结算备付金	3,735,285.22	-	-	-	3,735,285.22
存出保证金	2,141,807.03	-	-	-	2,141,807.03
交易性金融资产	-	-	-	-319,249,728.76	319,249,728.76
应收清算款	-	-	-	295,213.21	295,213.21
资产总计	20,920,529.42	-	-	-319,544,941.97	340,465,471.39
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	46,180.87	46,180.87
应付托管费	-	-	-	15,393.64	15,393.64
应交税费	-	-	-	36,203.19	36,203.19
其他负债	-	-	-	484,260.14	484,260.14
负债总计	-	-	-	582,037.84	582,037.84

利率敏感度缺口	20,920,529.42	-	-318,962,904.13	339,883,433.55
---------	---------------	---	-----------------	----------------

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（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，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。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	280,731,442.89	94.59	319,249,728.76	93.93
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	280,731,442.89	94.59	319,249,728.76	93.93

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	14,656,683.04	16,756,253.27
	比较基准下降 5%资产净值变动	-14,656,683.04	-16,756,253.27

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	280, 312, 700. 11
第二层次	15, 385. 54
第三层次	403, 357. 24
合计	280, 731, 442. 89

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	280,731,442.89	94.33
	其中：股票	280,731,442.89	94.33
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	15,142,543.98	5.09
8	其他各项资产	1,746,013.06	0.59
9	合计	297,619,999.93	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：1,294,402.92 元，占净值比 0.44%。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	696,612.00	0.23
B	采矿业	10,003,417.15	3.37
C	制造业	177,504,001.11	59.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,020,851.20	3.04
E	建筑业	2,460,344.00	0.83
F	批发和零售业	6,138,650.86	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	4,652,644.00	1.57
H	住宿和餐饮业	749,513.43	0.25
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,118,664.18	8.80
J	金融业	27,556,887.31	9.29
K	房地产业	3,461,816.00	1.17
L	租赁和商务服务	2,408,940.40	0.81

	业		
M	科学研究和技术服务业	1,888,532.30	0.64
N	水利、环境和公共设施管理业	1,170,720.58	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	574,974.00	0.19
Q	卫生和社会工作	1,294,102.72	0.44
R	文化、体育和娱乐业	3,931,369.00	1.32
S	综合	666,399.00	0.22
	合计	280,298,439.24	94.45

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	388,095.58	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,244.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	14,260.87	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	28,403.20	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	433,003.65	0.15

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	300476	胜宏科技	23,100	3,104,178.00	1.05
2	000988	华工科技	38,300	1,800,483.00	0.61
3	600988	赤峰黄金	63,300	1,574,904.00	0.53
4	300339	润和软件	30,400	1,545,232.00	0.52
5	002966	苏州银行	170,280	1,495,058.40	0.50
6	600839	四川长虹	140,600	1,366,632.00	0.46
7	601162	天风证券	270,300	1,332,579.00	0.45
8	601555	东吴证券	151,390	1,324,662.50	0.45
9	688521	芯原股份	13,560	1,308,540.00	0.44
10	689009	九号公司-WD	21,876	1,294,402.92	0.44
11	002517	恺英网络	65,000	1,255,150.00	0.42
12	002340	格林美	195,200	1,239,520.00	0.42
13	002195	岩山科技	216,400	1,218,332.00	0.41
14	002558	巨人网络	51,400	1,210,470.00	0.41
15	603893	瑞芯微	7,900	1,199,694.00	0.40
16	002261	拓维信息	38,300	1,185,385.00	0.40
17	002156	通富微电	46,218	1,184,105.16	0.40
18	600487	亨通光电	75,100	1,149,030.00	0.39
19	688608	恒玄科技	3,291	1,145,202.18	0.39
20	600157	永泰能源	846,400	1,134,176.00	0.38
21	002797	第一创业	160,100	1,133,508.00	0.38
22	300251	光线传媒	55,800	1,131,066.00	0.38
23	300207	欣旺达	56,200	1,127,372.00	0.38
24	300803	指南针	13,765	1,110,284.90	0.37
25	688213	思特威-W	10,729	1,096,718.38	0.37
26	000066	中国长城	73,600	1,089,280.00	0.37
27	688777	中控技术	24,073	1,081,118.43	0.36
28	600096	云天化	48,600	1,067,742.00	0.36
29	600536	中国软件	22,802	1,066,449.54	0.36
30	688235	百济神州-U	4,553	1,063,762.92	0.36
31	002273	水晶光电	52,800	1,054,416.00	0.36
32	601168	西部矿业	63,400	1,054,342.00	0.36
33	002465	海格通信	75,600	1,053,864.00	0.36
34	600879	航天电子	100,400	1,051,188.00	0.35
35	688120	华海清科	6,190	1,044,253.00	0.35
36	300450	先导智能	41,800	1,038,730.00	0.35

37	000831	中国稀土	28,300	1,022,196.00	0.34
38	601099	太平洋	259,500	1,019,835.00	0.34
39	688617	惠泰医疗	3,399	1,009,503.00	0.34
40	002294	信立泰	21,300	1,008,129.00	0.34
41	600352	浙江龙盛	99,000	1,005,840.00	0.34
42	000933	神火股份	60,000	998,400.00	0.34
43	300017	网宿科技	93,100	998,032.00	0.34
44	600885	宏发股份	44,308	988,511.48	0.33
45	002185	华天科技	97,700	986,770.00	0.33
46	688002	睿创微纳	14,097	982,842.84	0.33
47	601108	财通证券	123,800	979,258.00	0.33
48	601128	常熟银行	126,391	931,501.67	0.31
49	688099	晶晨股份	13,034	925,544.34	0.31
50	002130	沃尔核材	38,400	914,688.00	0.31
51	601577	长沙银行	91,800	912,492.00	0.31
52	600079	人福医药	43,400	910,532.00	0.31
53	002281	光迅科技	18,400	907,488.00	0.31
54	300454	深信服	9,600	904,128.00	0.30
55	300223	北京君正	13,000	899,600.00	0.30
56	002085	万丰奥威	56,600	899,374.00	0.30
57	688469	芯联集成-U	188,527	899,273.79	0.30
58	688122	西部超导	17,323	898,717.24	0.30
59	000423	东阿阿胶	17,100	894,330.00	0.30
60	002595	豪迈科技	15,100	894,222.00	0.30
61	000997	新大陆	27,500	890,450.00	0.30
62	603129	春风动力	4,100	887,650.00	0.30
63	300058	蓝色光标	134,840	884,550.40	0.30
64	002532	天山铝业	106,400	884,184.00	0.30
65	002738	中矿资源	27,461	883,145.76	0.30
66	300002	神州泰岳	74,700	881,460.00	0.30
67	300458	全志科技	22,100	877,149.00	0.30
68	300474	景嘉微	12,000	876,000.00	0.30
69	000783	长江证券	126,200	874,566.00	0.29
70	600109	国金证券	98,840	866,826.80	0.29
71	002138	顺络电子	30,700	863,284.00	0.29
72	002472	双环传动	25,700	860,693.00	0.29
73	002078	太阳纸业	63,800	858,748.00	0.29
74	002436	兴森科技	64,300	851,332.00	0.29
75	603596	伯特利	16,116	849,152.04	0.29
76	601933	永辉超市	172,900	847,210.00	0.29
77	002410	广联达	62,800	842,148.00	0.28
78	600862	中航高科	31,930	832,734.40	0.28
79	002851	麦格米特	16,600	832,324.00	0.28

80	688525	佰维存储	12,346	832,120.40	0.28
81	300346	南大光电	26,220	829,600.80	0.28
82	600143	金发科技	80,200	826,862.00	0.28
83	600580	卧龙电驱	41,760	825,595.20	0.28
84	300136	信维通信	36,800	824,320.00	0.28
85	300765	新诺威	15,940	823,938.60	0.28
86	601198	东兴证券	73,800	822,870.00	0.28
87	002065	东华软件	85,500	820,800.00	0.28
88	300054	鼎龙股份	28,600	820,248.00	0.28
89	300024	机器人	47,700	819,486.00	0.28
90	600298	安琪酵母	23,300	819,461.00	0.28
91	002223	鱼跃医疗	23,000	818,800.00	0.28
92	000034	神州数码	21,700	816,788.00	0.28
93	600363	联创光电	14,000	816,620.00	0.28
94	002850	科达利	7,200	814,824.00	0.27
95	600873	梅花生物	76,100	813,509.00	0.27
96	002353	杰瑞股份	23,200	812,000.00	0.27
97	002202	金风科技	79,000	809,750.00	0.27
98	300395	菲利华	15,800	807,380.00	0.27
99	603606	东方电缆	15,600	806,676.00	0.27
100	002673	西部证券	102,100	804,548.00	0.27
101	601615	明阳智能	69,300	796,257.00	0.27
102	688578	艾力斯	8,554	795,864.16	0.27
103	300496	中科创达	13,900	795,358.00	0.27
104	688072	拓荆科技	5,120	786,995.20	0.27
105	000728	国元证券	99,626	786,049.14	0.26
106	300857	协创数据	9,100	783,146.00	0.26
107	002008	大族激光	32,100	782,277.00	0.26
108	300383	光环新网	54,700	782,210.00	0.26
109	000021	深科技	41,700	781,458.00	0.26
110	002624	完美世界	51,500	781,255.00	0.26
111	300115	长盈精密	36,100	772,540.00	0.26
112	603659	璞泰来	40,800	766,224.00	0.26
113	603087	甘李药业	13,900	761,442.00	0.26
114	600895	张江高科	29,500	758,150.00	0.26
115	600549	厦门钨业	36,200	757,304.00	0.26
116	603605	珀莱雅	9,100	753,389.00	0.25
117	300604	长川科技	16,700	749,997.00	0.25
118	300012	华测检测	64,000	748,160.00	0.25
119	000426	兴业银锡	47,300	747,340.00	0.25
120	688220	翱捷科技-U	9,530	746,199.00	0.25
121	002155	湖南黄金	41,799	746,112.15	0.25
122	603160	汇顶科技	10,500	745,815.00	0.25

123	600171	上海贝岭	21,700	743,225.00	0.25
124	000733	振华科技	14,600	730,730.00	0.25
125	300627	华测导航	20,820	728,700.00	0.25
126	688361	中科飞测	8,473	713,341.87	0.24
127	605589	圣泉集团	25,700	713,175.00	0.24
128	601216	君正集团	128,400	708,768.00	0.24
129	300699	光威复材	22,220	703,707.40	0.24
130	300037	新宙邦	19,960	702,592.00	0.24
131	600392	盛和资源	53,300	701,961.00	0.24
132	000750	国海证券	170,300	701,636.00	0.24
133	601665	齐鲁银行	110,900	700,888.00	0.24
134	000519	中兵红箭	31,900	698,291.00	0.24
135	688052	纳芯微	4,001	698,134.49	0.24
136	002444	巨星科技	27,245	695,019.95	0.23
137	601997	贵阳银行	111,300	694,512.00	0.23
138	000932	华菱钢铁	157,800	694,320.00	0.23
139	688180	君实生物-U	20,413	693,633.74	0.23
140	000729	燕京啤酒	53,600	693,048.00	0.23
141	300003	乐普医疗	50,200	691,756.00	0.23
142	600153	建发股份	66,200	686,494.00	0.23
143	600060	海信视像	29,800	685,996.00	0.23
144	601717	郑煤机	41,200	684,744.00	0.23
145	601990	南京证券	84,200	680,336.00	0.23
146	601233	桐昆股份	64,000	678,400.00	0.23
147	000878	云南铜业	53,300	677,976.00	0.23
148	601696	中银证券	63,400	677,746.00	0.23
149	300001	特锐德	28,100	673,557.00	0.23
150	688027	国盾量子	2,442	671,574.42	0.23
151	300073	当升科技	15,300	671,211.00	0.23
152	002821	凯莱英	7,600	670,700.00	0.23
153	300142	沃森生物	60,700	667,700.00	0.22
154	600673	东阳光	57,300	666,399.00	0.22
155	002414	高德红外	65,000	666,250.00	0.22
156	600369	西南证券	151,900	660,765.00	0.22
157	002837	英维克	22,200	659,562.00	0.22
158	002007	华兰生物	41,900	656,573.00	0.22
159	603979	金诚信	14,100	654,804.00	0.22
160	600699	均胜电子	37,500	654,000.00	0.22
161	688065	凯赛生物	13,826	651,204.60	0.22
162	300373	扬杰科技	12,500	648,750.00	0.22
163	600118	中国卫星	22,600	645,682.00	0.22
164	600177	雅戈尔	88,100	643,130.00	0.22
165	600521	华海药业	34,300	639,009.00	0.22

166	000893	亚钾国际	21,200	638,968.00	0.22
167	600398	海澜之家	91,400	636,144.00	0.21
168	002152	广电运通	47,300	635,712.00	0.21
169	600435	北方导航	40,300	628,277.00	0.21
170	603345	安井食品	7,800	627,276.00	0.21
171	000738	航发控制	30,100	624,575.00	0.21
172	600704	物产中大	118,500	624,495.00	0.21
173	600909	华安证券	107,040	624,043.20	0.21
174	688249	晶合集成	30,731	622,917.37	0.21
175	300748	金力永磁	26,080	621,747.20	0.21
176	000623	吉林敖东	36,400	616,980.00	0.21
177	600497	驰宏锌锗	116,400	615,756.00	0.21
178	603179	新泉股份	13,100	615,307.00	0.21
179	600316	洪都航空	16,300	614,510.00	0.21
180	688385	复旦微电	12,467	614,249.09	0.21
181	002044	美年健康	119,200	612,688.00	0.21
182	000009	中国宝安	68,868	611,547.84	0.21
183	002958	青农商行	169,300	611,173.00	0.21
184	688188	柏楚电子	4,614	607,479.24	0.20
185	600765	中航重机	35,960	607,004.80	0.20
186	002318	久立特材	25,900	605,801.00	0.20
187	600141	兴发集团	29,400	603,582.00	0.20
188	600038	中直股份	15,500	601,555.00	0.20
189	002409	雅克科技	10,900	596,121.00	0.20
190	600562	国睿科技	18,860	593,901.40	0.20
191	603228	景旺电子	14,120	590,780.80	0.20
192	000528	柳工	61,400	590,054.00	0.20
193	000400	许继电气	27,100	589,967.00	0.20
194	600155	华创云信	84,701	589,518.96	0.20
195	002683	广东宏大	17,300	587,162.00	0.20
196	001696	宗申动力	26,100	585,945.00	0.20
197	300919	中伟股份	17,800	585,264.00	0.20
198	300757	罗博特科	3,900	584,883.00	0.20
199	300724	捷佳伟创	10,600	575,580.00	0.19
200	000960	锡业股份	37,600	575,280.00	0.19
201	002607	中公教育	187,900	574,974.00	0.19
202	600637	东方明珠	76,800	573,696.00	0.19
203	600498	烽火通信	27,000	567,810.00	0.19
204	603939	益丰药房	23,200	567,704.00	0.19
205	600884	杉杉股份	60,000	567,600.00	0.19
206	300623	捷捷微电	19,000	566,200.00	0.19
207	300558	贝达药业	9,600	556,320.00	0.19
208	600529	山东药玻	25,100	555,714.00	0.19

209	688568	中科星图	15,418	555,202.18	0.19
210	002739	万达电影	48,300	552,069.00	0.19
211	688017	绿的谐波	4,409	550,640.01	0.19
212	000039	中集集团	70,000	550,200.00	0.19
213	000415	渤海租赁	164,700	548,451.00	0.18
214	002841	视源股份	15,800	546,680.00	0.18
215	600563	法拉电子	5,000	545,450.00	0.18
216	002653	海思科	12,900	544,638.00	0.18
217	002025	航天电器	10,500	539,805.00	0.18
218	600486	扬农化工	9,290	538,820.00	0.18
219	002926	华西证券	60,100	537,294.00	0.18
220	301358	湖南裕能	17,200	536,468.00	0.18
221	600901	江苏金租	88,360	535,461.60	0.18
222	000887	中鼎股份	30,100	529,459.00	0.18
223	002385	大北农	131,000	529,240.00	0.18
224	300285	国瓷材料	30,390	527,266.50	0.18
225	300763	锦浪科技	9,100	522,249.00	0.18
226	002939	长城证券	61,300	513,694.00	0.17
227	300144	宋城演艺	60,000	513,000.00	0.17
228	300679	电连技术	11,300	512,794.00	0.17
229	603486	科沃斯	8,800	512,424.00	0.17
230	002568	百润股份	20,000	512,200.00	0.17
231	600820	隧道股份	83,800	511,180.00	0.17
232	600863	内蒙华电	124,300	510,873.00	0.17
233	688114	华大智造	7,858	509,434.14	0.17
234	688582	芯动联科	7,547	507,158.40	0.17
235	600132	重庆啤酒	9,200	506,920.00	0.17
236	600008	首创环保	167,700	506,454.00	0.17
237	000723	美锦能源	117,200	506,304.00	0.17
238	000513	丽珠集团	14,000	504,560.00	0.17
239	002064	华峰化学	75,600	499,716.00	0.17
240	600390	五矿资本	85,700	499,631.00	0.17
241	600516	方大炭素	107,400	498,336.00	0.17
242	600763	通策医疗	12,049	497,382.72	0.17
243	002080	中材科技	25,400	495,300.00	0.17
244	600998	九州通	96,059	493,743.26	0.17
245	002312	川发龙蟒	43,000	493,640.00	0.17
246	688538	和辉光电-U	210,602	492,808.68	0.17
247	603568	伟明环保	25,826	492,760.08	0.17
248	000703	恒逸石化	83,700	492,156.00	0.17
249	600166	福田汽车	181,000	490,510.00	0.17
250	688183	生益电子	9,575	490,240.00	0.17
251	300487	蓝晓科技	9,700	487,910.00	0.16

252	600170	上海建工	202,900	484,931.00	0.16
253	002262	恩华药业	23,300	484,174.00	0.16
254	603589	口子窖	13,900	483,720.00	0.16
255	601179	中国西电	78,200	480,148.00	0.16
256	600208	衢州发展	162,100	479,816.00	0.16
257	603816	顾家家居	18,800	479,776.00	0.16
258	600312	平高电气	31,100	478,629.00	0.16
259	002500	山西证券	81,920	478,412.80	0.16
260	605358	立昂微	20,500	477,650.00	0.16
261	000683	博源化工	99,000	474,210.00	0.16
262	300676	华大基因	9,500	472,815.00	0.16
263	002203	海亮股份	45,590	470,488.80	0.16
264	600021	上海电力	53,500	470,265.00	0.16
265	601155	新城控股	34,300	469,224.00	0.16
266	002432	九安医疗	12,800	466,304.00	0.16
267	600985	淮北矿业	41,100	466,074.00	0.16
268	600380	健康元	41,900	462,157.00	0.16
269	002244	滨江集团	47,400	462,150.00	0.16
270	600126	杭钢股份	51,300	461,700.00	0.16
271	688728	格科微	29,859	459,828.60	0.15
272	603338	浙江鼎力	9,700	459,780.00	0.15
273	600583	海油工程	84,200	459,732.00	0.15
274	000591	太阳能	104,500	458,755.00	0.15
275	601000	唐山港	112,800	457,968.00	0.15
276	600348	华阳股份	68,750	457,875.00	0.15
277	000403	派林生物	25,190	456,694.70	0.15
278	000060	中金岭南	99,500	455,710.00	0.15
279	000629	钒钛股份	176,900	452,864.00	0.15
280	000921	海信家电	17,600	452,320.00	0.15
281	002603	以岭药业	31,900	449,790.00	0.15
282	603379	三美股份	9,340	449,440.80	0.15
283	601991	大唐发电	141,600	448,872.00	0.15
284	603885	吉祥航空	33,300	448,551.00	0.15
285	600872	中炬高新	23,600	448,400.00	0.15
286	000830	鲁西化工	43,500	448,050.00	0.15
287	600535	天士力	28,400	444,460.00	0.15
288	300567	精测电子	7,300	442,453.00	0.15
289	600816	建元信托	149,900	442,205.00	0.15
290	002439	启明星辰	27,600	441,324.00	0.15
291	002984	森麒麟	23,500	440,625.00	0.15
292	002056	横店东磁	31,000	438,650.00	0.15
293	688278	特宝生物	6,076	438,140.36	0.15
294	300146	汤臣倍健	38,900	437,236.00	0.15

295	600095	湘财股份	43,400	435,302.00	0.15
296	600970	中材国际	50,300	431,574.00	0.15
297	603927	中科软	22,256	430,431.04	0.15
298	601880	辽港股份	285,700	428,550.00	0.14
299	600499	科达制造	43,702	428,279.60	0.14
300	002423	中粮资本	35,000	428,050.00	0.14
301	601016	节能风电	147,820	427,199.80	0.14
302	603000	人民网	21,100	426,431.00	0.14
303	000636	风华高科	30,900	424,566.00	0.14
304	000062	深圳华强	15,800	424,388.00	0.14
305	300390	天华新能	22,250	424,307.50	0.14
306	600685	中船防务	15,500	421,445.00	0.14
307	601611	中国核建	45,800	420,902.00	0.14
308	000958	电投产融	61,300	419,292.00	0.14
309	603298	杭叉集团	20,000	419,000.00	0.14
310	601666	平煤股份	56,500	418,665.00	0.14
311	300212	易华录	19,200	417,792.00	0.14
312	600859	王府井	30,000	416,700.00	0.14
313	000563	陕国投 A	116,700	416,619.00	0.14
314	603737	三棵树	11,292	416,110.20	0.14
315	600511	国药股份	14,200	414,072.00	0.14
316	601456	国联民生	39,900	412,965.00	0.14
317	688297	中无人机	7,733	412,942.20	0.14
318	000155	川能动力	42,000	412,440.00	0.14
319	688301	奕瑞科技	4,707	412,380.27	0.14
320	603077	和邦生物	235,500	412,125.00	0.14
321	600655	豫园股份	74,100	411,255.00	0.14
322	000598	兴蓉环境	56,800	409,528.00	0.14
323	600004	白云机场	45,000	409,500.00	0.14
324	600325	华发股份	83,800	408,106.00	0.14
325	601966	玲珑轮胎	27,800	407,826.00	0.14
326	300677	英科医疗	17,200	407,296.00	0.14
327	600131	国网信通	23,000	407,100.00	0.14
328	600483	福能股份	42,200	406,808.00	0.14
329	603156	养元饮品	19,200	406,272.00	0.14
330	603899	晨光股份	13,900	402,961.00	0.14
331	002773	康弘药业	13,900	402,683.00	0.14
332	601958	金钼股份	36,800	402,592.00	0.14
333	301308	江波龙	4,600	402,454.00	0.14
334	688520	神州细胞	6,677	399,618.45	0.13
335	000050	深天马 A	46,800	398,736.00	0.13
336	600663	陆家嘴	44,900	397,814.00	0.13
337	000951	中国重汽	22,500	395,550.00	0.13

338	600378	昊华科技	14,600	395,222.00	0.13
339	002507	涪陵榨菜	30,840	394,443.60	0.13
340	600282	南钢股份	93,900	394,380.00	0.13
341	002756	永兴材料	12,400	393,700.00	0.13
342	000987	越秀资本	57,275	392,906.50	0.13
343	300529	健帆生物	18,200	392,574.00	0.13
344	600754	锦江酒店	17,400	390,456.00	0.13
345	600271	航天信息	42,200	389,928.00	0.13
346	601001	晋控煤业	31,900	389,818.00	0.13
347	600598	北大荒	27,000	389,340.00	0.13
348	300601	康泰生物	25,400	385,826.00	0.13
349	000559	万向钱潮	50,400	385,560.00	0.13
350	600737	中粮糖业	40,800	385,560.00	0.13
351	603290	斯达半导	4,740	385,219.80	0.13
352	601918	新集能源	59,300	383,078.00	0.13
353	600739	辽宁成大	34,800	382,800.00	0.13
354	301536	星宸科技	6,300	379,890.00	0.13
355	688234	天岳先进	6,458	378,115.90	0.13
356	002429	兆驰股份	86,200	377,556.00	0.13
357	600582	天地科技	62,900	376,771.00	0.13
358	688363	华熙生物	7,323	376,036.05	0.13
359	601333	广深铁路	129,100	373,099.00	0.13
360	300070	碧水源	82,761	372,424.50	0.13
361	600764	中国海防	10,900	370,600.00	0.12
362	601866	中远海发	149,700	369,759.00	0.12
363	688772	珠海冠宇	25,841	369,267.89	0.12
364	002120	韵达股份	55,100	369,170.00	0.12
365	603688	石英股份	10,400	366,288.00	0.12
366	600566	济川药业	13,900	365,987.00	0.12
367	601231	环旭电子	25,000	365,750.00	0.12
368	600867	通化东宝	44,600	365,720.00	0.12
369	300888	稳健医疗	8,880	364,968.00	0.12
370	300735	光弘科技	14,500	363,950.00	0.12
371	600329	达仁堂	10,900	363,624.00	0.12
372	002430	杭氧股份	18,700	363,154.00	0.12
373	603728	鸣志电器	6,300	362,061.00	0.12
374	300751	迈为股份	5,200	361,712.00	0.12
375	003031	中瓷电子	6,760	359,699.60	0.12
376	688561	奇安信-U	10,567	359,066.66	0.12
377	600258	首旅酒店	25,411	359,057.43	0.12
378	601098	中南传媒	27,300	358,176.00	0.12
379	603341	龙旗科技	8,800	357,544.00	0.12
380	600995	南网储能	36,400	355,992.00	0.12

381	601212	白银有色	112,800	353,064.00	0.12
382	688778	厦钨新能	6,309	352,799.28	0.12
383	600707	彩虹股份	54,600	352,716.00	0.12
384	688676	金盘科技	10,493	350,990.85	0.12
385	000032	深桑达 A	17,300	349,979.00	0.12
386	688318	财富趋势	3,040	349,356.80	0.12
387	000027	深圳能源	54,280	346,306.40	0.12
388	600578	京能电力	76,500	343,485.00	0.12
389	603858	步长制药	21,100	342,664.00	0.12
390	002508	老板电器	18,000	342,180.00	0.12
391	603529	爱玛科技	9,900	340,560.00	0.11
392	000709	河钢股份	157,400	339,984.00	0.11
393	301498	乖宝宠物	3,100	339,047.00	0.11
394	600906	财达证券	49,500	337,590.00	0.11
395	002299	圣农发展	23,500	335,815.00	0.11
396	000967	盈峰环境	48,200	334,990.00	0.11
397	000883	湖北能源	74,200	334,642.00	0.11
398	300573	兴齐眼药	6,460	334,563.40	0.11
399	002670	国盛金控	22,200	334,110.00	0.11
400	600517	国网英大	65,300	333,030.00	0.11
401	600848	上海临港	36,400	330,148.00	0.11
402	601399	国机重装	109,800	329,400.00	0.11
403	600546	山煤国际	37,700	329,121.00	0.11
404	002831	裕同科技	14,000	327,880.00	0.11
405	600959	江苏有线	95,200	327,488.00	0.11
406	601928	凤凰传媒	29,100	325,047.00	0.11
407	600968	海油发展	77,500	316,200.00	0.11
408	600808	马钢股份	91,100	314,295.00	0.11
409	601156	东航物流	24,000	314,160.00	0.11
410	000739	普洛药业	22,400	313,600.00	0.11
411	300595	欧普康视	20,500	313,035.00	0.11
412	000825	太钢不锈	87,000	312,330.00	0.11
413	600528	中铁工业	42,100	310,698.00	0.10
414	002572	索菲亚	22,100	309,621.00	0.10
415	603225	新凤鸣	29,000	308,850.00	0.10
416	601118	海南橡胶	65,100	307,272.00	0.10
417	603565	中谷物流	32,100	306,555.00	0.10
418	601636	旗滨集团	61,100	306,111.00	0.10
419	301301	川宁生物	25,400	305,816.00	0.10
420	002266	浙富控股	99,200	305,536.00	0.10
421	601608	中信重工	69,900	305,463.00	0.10
422	600977	中国电影	28,400	304,448.00	0.10
423	600801	华新水泥	25,500	301,920.00	0.10

424	600871	石化油服	154,600	301,470.00	0.10
425	000543	皖能电力	43,000	301,000.00	0.10
426	601598	中国外运	60,100	296,293.00	0.10
427	600056	中国医药	28,500	294,690.00	0.10
428	688387	信科移动-U	51,963	293,590.95	0.10
429	600062	华润双鹤	15,700	292,962.00	0.10
430	601106	中国一重	104,500	292,600.00	0.10
431	603650	彤程新材	9,100	292,565.00	0.10
432	000582	北部湾港	35,300	291,225.00	0.10
433	688563	航材股份	5,122	290,058.86	0.10
434	000785	居然智家	94,900	289,445.00	0.10
435	300957	贝泰妮	6,400	283,008.00	0.10
436	603233	大参林	17,292	281,859.60	0.09
437	688702	盛科通信-U	4,517	275,898.36	0.09
438	600925	苏能股份	52,300	273,529.00	0.09
439	600373	中文传媒	26,500	272,155.00	0.09
440	002153	石基信息	31,242	270,555.72	0.09
441	601965	中国汽研	15,200	269,800.00	0.09
442	000429	粤高速 A	19,900	265,267.00	0.09
443	000537	中绿电	31,500	263,340.00	0.09
444	600606	绿地控股	160,600	261,778.00	0.09
445	688281	华秦科技	4,270	258,377.70	0.09
446	601568	北元集团	60,640	251,656.00	0.08
447	600098	广州发展	40,100	250,625.00	0.08
448	002372	伟星新材	24,100	249,676.00	0.08
449	600361	创新新材	62,400	248,976.00	0.08
450	001286	陕西能源	28,500	247,950.00	0.08
451	688425	铁建重工	60,772	247,949.76	0.08
452	603658	安图生物	6,500	243,750.00	0.08
453	003022	联泓新科	15,100	239,033.00	0.08
454	600688	上海石化	83,700	238,545.00	0.08
455	688349	三一重能	9,414	234,785.16	0.08
456	600612	老凤祥	4,700	233,825.00	0.08
457	301165	锐捷网络	3,780	232,318.80	0.08
458	000937	冀中能源	40,400	232,300.00	0.08
459	601019	山东出版	23,700	224,439.00	0.08
460	002608	江苏国信	28,800	211,104.00	0.07
461	000898	鞍钢股份	90,800	210,656.00	0.07
462	600339	中油工程	63,700	208,299.00	0.07
463	601139	深圳燃气	32,700	207,972.00	0.07
464	600032	浙江新能	27,400	207,144.00	0.07
465	603707	健友股份	18,417	205,349.55	0.07
466	688100	威胜信息	5,537	205,145.85	0.07

467	600720	中交设计	26,100	201,753.00	0.07
468	000959	首钢股份	59,300	201,620.00	0.07
469	688032	禾迈股份	2,010	200,718.60	0.07
470	688248	南网科技	6,355	199,928.30	0.07
471	600928	西安银行	50,900	199,528.00	0.07
472	003035	南网能源	43,100	197,829.00	0.07
473	600295	鄂尔多斯	22,700	197,717.00	0.07
474	002461	珠江啤酒	16,800	189,672.00	0.06
475	603556	海兴电力	7,400	188,478.00	0.06
476	688375	国博电子	3,108	186,511.08	0.06
477	601228	广州港	57,500	185,725.00	0.06
478	688475	萤石网络	5,859	184,675.68	0.06
479	301267	华夏眼科	9,600	184,032.00	0.06
480	688172	燕东微	9,190	180,675.40	0.06
481	603786	科博达	3,200	177,312.00	0.06
482	600927	永安期货	11,200	165,872.00	0.06
483	601061	中信金属	20,600	162,946.00	0.05
484	002563	森马服饰	30,800	162,008.00	0.05
485	600007	中国国贸	7,600	156,408.00	0.05
486	000539	粤电力 A	33,800	153,452.00	0.05
487	002945	华林证券	10,300	148,011.00	0.05
488	600299	安迪苏	15,200	146,680.00	0.05
489	603826	坤彩科技	7,460	145,992.20	0.05
490	300140	节能环保	23,400	144,378.00	0.05
491	688819	天能股份	5,167	143,435.92	0.05
492	001213	中铁特货	33,700	136,822.00	0.05
493	601921	浙版传媒	16,900	136,214.00	0.05
494	601858	中国科传	5,900	114,755.00	0.04
495	688153	唯捷创芯	3,449	106,953.49	0.04
496	601158	重庆水务	22,000	102,080.00	0.03
497	600956	新天绿能	11,800	91,096.00	0.03
498	001389	广合科技	1,500	88,155.00	0.03
499	688295	中复神鹰	3,971	82,596.80	0.03
500	603868	飞科电器	1,900	68,153.00	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	688411	海博思创	560	46,754.40	0.02
2	688775	影石创新	216	26,818.56	0.01
3	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.01
4	688545	兴福电子	758	20,428.10	0.01
5	688583	思看科技	227	18,087.36	0.01
6	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.01

7	301602	超研股份	658	16,318.40	0.01
8	301275	汉朔科技	279	15,677.01	0.01
9	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
10	001391	国货航	2,119	14,260.87	0.00
11	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
12	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
13	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
14	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
15	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
16	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
17	301501	恒鑫生活	244	11,033.68	0.00
18	603072	天和磁材	192	10,454.40	0.00
19	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
20	001356	富岭股份	673	9,718.12	0.00
21	301590	优优绿能	64	8,926.72	0.00
22	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
23	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
24	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
25	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
26	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
27	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
28	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
29	603014	威高血净	140	4,575.20	0.00
30	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
31	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
32	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
33	603202	天有为	42	3,807.72	0.00
34	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
35	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
36	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
37	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
38	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
39	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
40	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
41	400174	中天 3	286,500	0.00	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	688608	恒玄科技	1,214,610.52	0.36
2	688235	百济神州-U	1,212,950.34	0.36
3	000933	神火股份	1,069,865.00	0.31
4	300450	先导智能	936,047.00	0.28

5	300454	深信服	918,656.00	0.27
6	002130	沃尔核材	902,112.00	0.27
7	300458	全志科技	879,438.00	0.26
8	600363	联创光电	876,807.00	0.26
9	002851	麦格米特	837,506.00	0.25
10	300346	南大光电	831,812.40	0.24
11	300857	协创数据	788,121.00	0.23
12	300115	长盈精密	774,419.00	0.23
13	605589	圣泉集团	731,762.00	0.22
14	600171	上海贝岭	731,165.00	0.22
15	002007	华兰生物	729,286.00	0.21
16	603659	璞泰来	707,222.00	0.21
17	300627	华测导航	690,941.00	0.20
18	688120	华海清科	688,647.59	0.20
19	688027	国盾量子	661,602.51	0.19
20	002837	英维克	622,723.00	0.18

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	600418	江淮汽车	3,940,178.00	1.16
2	002625	光启技术	2,293,303.00	0.67
3	002384	东山精密	1,698,070.00	0.50
4	688047	龙芯中科	1,288,111.85	0.38
5	301236	软通动力	1,207,801.00	0.36
6	302132	中航成飞	968,283.90	0.28
7	600642	申能股份	936,597.00	0.28
8	300866	安克创新	924,098.40	0.27
9	601567	三星医疗	923,709.00	0.27
10	002128	电投能源	915,601.00	0.27
11	688120	华海清科	720,987.59	0.21
12	688072	拓荆科技	707,545.56	0.21
13	688536	思瑞浦	677,225.21	0.20
14	688777	中控技术	672,589.35	0.20
15	603893	瑞芯微	669,024.00	0.20
16	600839	四川长虹	662,634.00	0.19
17	688331	荣昌生物	631,887.94	0.19
18	600988	赤峰黄金	630,885.00	0.19
19	600416	湘电股份	585,812.00	0.17
20	688005	容百科技	578,501.58	0.17

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	79,758,862.23
卖出股票收入（成交）总额	98,583,294.15

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

东吴证券股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国证券监督管理委员会的处罚。

胜宏科技(惠州)股份有限公司在报告编制日前一年内受到中华人民共和国梅沙海关的处罚。

苏州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江苏监管局的处罚。

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	1,678,949.65
2	应收清算款	67,063.41
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	-
8	其他	-
9	合计	1,746,013.06

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	688411	海博思创	46,754.40	0.02	新股流通受限
2	688775	影石创新	26,818.56	0.01	新股流通受限
3	301458	钧崴电子	23,911.11	0.01	新股流通受限
4	688545	兴福电子	20,428.10	0.01	新股流通受限
5	688583	思看科技	18,087.36	0.01	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

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 (%)
7,122	27,269.20	66,552,765.00	34.27	127,658,488.00	65.73

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国工商银行股份有限公司-鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	45,084,637.00	23.21

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	招商证券股份有限公司	6,344,039.00	3.27
2	方正证券股份有限公司	3,032,803.00	1.56
3	上海柏泰华盈私募基金管理有限公司-柏泰华盈常青藤套利 2 号私募证券投资基金	2,674,800.00	1.38
4	中信建投证券股份有限公司	2,240,271.00	1.15
5	秦珺	2,040,800.00	1.05
6	王雪有	2,000,000.00	1.03
7	于明中	1,986,700.00	1.02
8	浙商证券股份有限公司	1,812,412.00	0.93
9	金佳	1,676,400.00	0.86
10	魏丽君	1,474,000.00	0.76
-	中国工商银行股份有限公司-鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	45,084,637.00	23.21

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（2019 年 11 月 21 日） 基金份额总额	490,211,253.00
本报告期期初基金份额总额	234,211,253.00
本报告期基金总申购份额	40,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	80,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	194,211,253.00

§ 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 (%)	
中泰证券	1	87,541,993.00	49.53	16,282.28	49.53	-
国泰君安证券	1	48,710,662.04	27.56	9,055.73	27.55	-
国信证券	2	39,037,841.64	22.08	7,259.51	22.08	-
方正证券	1	1,471,734.89	0.83	273.63	0.83	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国联民生证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

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 (%)
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东吴证	-	-	-	-	-	-

券						
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

注：无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东北证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、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 16 日
2	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	《中国证券报》、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
3	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	《中国证券报》、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
4	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证	2025 年 03 月 19 日

	人承担并修订基金合同的公告	监会基金电子披露网站	
5	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 20 日
6	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	《中国证券报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 20 日
7	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（2025 年第 1 号）	《中国证券报》、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 20 日
8	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	《中国证券报》、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 20 日
9	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	《中国证券报》、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
10	鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	《中国证券报》、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
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华西证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《中国证券报》、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 06 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	20250101~20250630	50,542,037.00	3,480,000.00	8,937,400.00	45,084,637.00	23.21
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比列过于集中时，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 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (二)《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (三)《鹏华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 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